

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA						
VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS						
Merc. Cot. Oficiais de Bolsa Val. Port.					7 643	1 862 198
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	680 834	100.26%	EUR	100.26%	637	683 242
CXGD 1% 01/2022	700 000	102.15%	EUR	102.15%	6 501	721 579
VERSE 3 SNR 02/2019	180 326	100.05%	EUR	100.05%	178	180 590
VERSE 4 SNR 02/2021	272 882	101.31%	EUR	101.31%	327	276 786
						1 862 198
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					360 108	95 859 718
Títulos de Dívida Pública						
SPGB 0.05% 10/2031	5 500 000	100.27%	EUR	100.27%	467	5 515 207
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	99.43%	EUR	99.43%	18 801	2 504 551
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.09%	EUR	100.09%		1 301 170
SAPGR Float 03/21	1 100 000	99.92%	EUR	99.92%		1 099 164
VW 1.375% 10/2023	500 000	98.86%	EUR	98.86%	1 450	495 755
SAPGR 0.25% 03/2022	500 000	100.06%	EUR	100.06%	75	500 370
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	100.71%	EUR	100.71%	3 440	1 211 900
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.20%	EUR	102.20%	3 797	1 434 625
RENAULT Float 08/20	100 000	99.33%	EUR	99.33%	31	99 356
BPCEGP Float 03/22	500 000	99.69%	EUR	99.69%	225	498 660
RENAULT Float 04/21	100 000	98.58%	EUR	98.58%	75	98 651
ACAFP Float 04/22	1 000 000	98.81%	EUR	98.81%	953	989 023
MCFP 0% 05/20	4 300 000	99.92%	EUR	99.92%		4 296 474
RENAUL Float 03/2022	400 000	96.95%	EUR	96.95%	72	387 876
GFCFP Float 06/22	800 000	98.31%	EUR	98.31%	2	786 490
ALDFP Float 11/20	500 000	99.28%	EUR	99.28%	55	496 445
BNP Float 05/23	500 000	97.20%	EUR	97.20%	169	486 189
HSBC 0.2% 09/21	2 000 000	99.73%	EUR	99.73%	1 304	1 995 884
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	100.62%	EUR	100.62%	6 575	1 515 815
HSBC Float 09/22	250 000	98.01%	EUR	98.01%	14	245 034
F Float 08/20	300 000	97.90%	EUR	97.90%	55	293 767
WPPLN Float 05/20	800 000	99.37%	EUR	99.37%	4	794 964
SANUK Float 05/23	500 000	94.94%	EUR	94.94%	277	474 952
RBS Float 06/20	900 000	99.31%	EUR	99.31%	63	893 889
CCE FLOAT 11/21	500 000	99.14%	EUR	99.14%		495 715
RBS Float 03/2020	100 000	99.48%	EUR	99.48%	7	99 489
RBS Float 09/21	1 400 000	98.55%	EUR	98.55%	115	1 379 745
DGELN 0.25% 10/2021	1 550 000	100.11%	EUR	100.11%	754	1 552 490
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	104.00%	EUR	104.00%	6 557	1 046 547
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	106.44%	EUR	106.44%	32 990	1 097 410
SANSCF1% 05/21	1 400 000	101.33%	EUR	101.33%	8 438	1 427 058
IBESM Float 02/24	500 000	100.31%	EUR	100.31%	207	501 767
SANTAN Float 03/22	600 000	99.13%	EUR	99.13%	130	594 916

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.51%	EUR	99.51%	52	497 625
AMSSM Float 03/22	600 000	98.94%	EUR	98.94%	32	593 690
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	102.05%	EUR	102.05%	586	255 721
SCANIA Float 04/20	500 000	99.96%	EUR	99.96%	82	499 897
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	104.50%	EUR	104.50%	27 060	758 588
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	100.41%	EUR	100.41%	17 359	1 623 887
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	104.28%	EUR	104.28%	22 207	804 337
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	101.45%	EUR	101.45%	10 795	1 025 245
ISPIM Float 04/22	450 000	96.61%	EUR	96.61%	585	435 330
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	103.99%	EUR	103.99%	11 795	1 259 627
BAC 2.5% 07/2020	750 000	103.59%	EUR	103.59%	8 116	785 056
MS Float 01/22	500 000	99.42%	EUR	99.42%	340	497 430
BAC Float 02/22	200 000	100.05%	EUR	100.05%	147	200 245
BAC Float 05/23	400 000	98.22%	EUR	98.22%	293	393 177
GM Float 05/21	1 800 000	96.98%	EUR	96.98%	892	1 746 586
BATSLN Float 08/21	500 000	97.90%	EUR	97.90%	118	489 593
BAC Float 09/21	500 000	99.23%	EUR	99.23%	9	496 174
GS Float 09/23	900 000	95.27%	EUR	95.27%	39	857 460
UTX Float 11/19	1 500 000	99.83%	EUR	99.83%		1 497 465
MS Float 05/21	500 000	99.27%	EUR	99.27%	48	496 408
T Float 0.534% 09/23	1 500 000	98.75%	EUR	98.75%	623	1 481 911
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	101.32%	EUR	101.32%	1 492	1 217 368
UBS Float 04/2021	200 000	99.95%	EUR	99.95%	71	199 975
SCANIA Float 03/21	1 100 000	99.53%	EUR	99.53%	64	1 094 872
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	105.76%	EUR	105.76%	49 418	1 371 380
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	103.39%	EUR	103.39%	39 195	2 623 945
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	105.22%	EUR	105.22%	4 017	1 056 217
RENEPL 4.75% 10/2020	1 600 000	107.61%	EUR	107.61%	16 033	1 737 809
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	104.11%	EUR	104.11%	8 247	2 923 187
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	101.13%	EUR	101.13%	6 534	1 017 834
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	99.98%	EUR	99.98%	1 870	3 001 180
LPTY Float 11/20	800 000	98.72%	EUR	98.72%	256	789 992
MYL Float 05/20	800 000	99.33%	EUR	99.33%	155	794 779
AKZANA Float 11/19	900 000	99.99%	EUR	99.99%		899 883
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	99.91%	EUR	99.91%	20	499 575
LPTY Float 01/21	200 000	98.10%	EUR	98.10%	69	196 259
ADNA Float 03/21	200 000	99.80%	EUR	99.80%		199 592
DAIGR Float 04/20	300 000	99.99%	EUR	99.99%	127	300 100
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.09%	EUR	100.09%	29	500 494
BAYNGR 0.625% 12/22	100 000	99.57%	EUR	99.57%	29	99 597
BAYNGR Float 06/22	300 000	99.28%	EUR	99.28%	10	297 856
ABNANV 0.5% 07/2023	2 000 000	99.28%	EUR	99.28%	4 603	1 990 163
NIBCAP Float 07/20	900 000	100.03%	EUR	100.03%	287	900 584
DANBNK 0.5% 05/21	1 000 000	99.85%	EUR	99.85%	3 288	1 001 808
NYKRE Float 06/22	1 000 000	97.03%	EUR	97.03%	205	970 505
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.05%	EUR	100.05%	27	1 000 527
MINGNO 0.75% 03/23	1 500 000	99.71%	EUR	99.71%	5 610	1 501 260

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SPOLNO Float 09/21	1 900 000	99.89%	EUR	99.89%	56	1 897 928
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.12%	EUR	100.12%	68	600 779
KBCBB Float 11/22	500 000	98.46%	EUR	98.46%	117	492 412
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	102.40%	EUR	102.40%	20 342	2 068 382
DLTAS 2008-1 A	895 658	99.18%	EUR	99.18%	36	888 350
DHR Float 06/22	700 000	99.51%	EUR	99.51%		696 535
DE Float 09/20	1 000 000	99.80%	EUR	99.80%		998 010
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.10%	EUR	99.10%	35	495 535
MUFG 0.98% 10/2023	200 000	99.94%	EUR	99.94%	451	200 337
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	100.52%	EUR	100.52%	689	1 005 849
BCHINA Float 11/20	300 000	99.58%	EUR	99.58%	51	298 782
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	103.21%	EUR	103.21%	5 379	727 821
BACR Float 03/2021	900 000	93.37%	EUR	93.37%	32	840 362
GSFloat 10/2019	50 000	100.28%	EUR	100.28%	38	50 177
BAC Float 05/2019	700 000	100.16%	EUR	100.16%	1 244	702 329
C Float 11/2019	100 000	100.26%	EUR	100.26%	33	100 295
WFC Float 04/21	1 000 000	99.90%	EUR	99.90%	564	999 584
RY Float 03/2019	300 000	100.09%	EUR	100.09%	6	300 276
ISPIM Float 04/2019	600 000	100.12%	EUR	100.12%	927	601 641
ISPIM Float 06/20	200 000	99.86%	EUR	99.86%	62	199 774
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	100.49%	EUR	100.49%	44	201 022
						90 344 511
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					20 573	8 325 826
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	102.47%	EUR	102.47%	4 671	2 053 991
K 1.75% 05/2021	1 000 000	103.21%	EUR	103.21%	10 644	1 042 754
F Float 05/21	300 000	95.53%	EUR	95.53%	46	286 627
UBS Float 09/22	1 000 000	99.13%	EUR	99.13%	130	991 400
SUMIBK Float 09/20	900 000	100.41%	EUR	100.41%	33	903 750
TACHEM 0.375% 11/20	1 500 000	99.88%	EUR	99.88%	632	1 498 847
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	102.94%	EUR	102.94%	4 418	1 548 458
						8 325 826
						106 047 741

OUTROS VALORES

Outros Instrumentos de Dívida					2 255	9 302 255
Papel Comercial						
PC P.C.S.CAETANO 11ª EM 2.8000% 2018-12-20 a 2019-03-20			EUR		793	850 793
PC PAP.COM. EDA 19ª EM. 0.1700% 2018-12-19 a 2019-01-18			EUR		12	200 012
PC P.COM.UNILEVER 55ªEM 0.0800% 2018-12-05 a 2019-01-07			EUR		84	1 400 084
PC PAP.COM. EDA 27ª EM. 0.1500% 2018-12-27 a 2019-01-28			EUR		63	3 000 063
PC P.C.BAVIERA 20ª EM 2.8000% 2018-12-28 a 2019-01-28			EUR		249	800 249
PC P.COM.UNILEVER 55ªEM 0.0600% 2018-12-05 a 2019-01-07			EUR		54	1 200 054
PC P.COM.C.AMORIM 14ªEM 0.0800% 2018-12-10 a 2019-01-10			EUR		24	500 024
PC P.C.S.CAETANO 10ª EM 2.9000% 2018-11-05 a 2019-02-06			EUR		918	200 918
PC PC AMORIM INV 17 0.1000% 2018-11-30 a 2019-01-31			EUR		44	500 044

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
PC P.C.SOGRAPÉ 51ª EM. 0.2000% 2018-12-28 a 2019-01-25			EUR		3	150 003
PC P.C.SOGRAPÉ 51ª EM. 0.1700% 2018-12-28 a 2019-01-25			EUR		9	500 009
						9 302 255
						9 302 255

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						22 419 972
CXG LIQUIDEZ	4 224 285	5.31	EUR	5.31		22 419 972
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 733 121
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	99.47	EUR	99.47		24 733 121
						47 153 093

LIQUIDEZ

À vista						10 546 773
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			10 326 660
DO EUR-RBS (GR+ 0.0000%			EUR			210 125
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			4 987
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			5 000
						10 546 773
A prazo					37 925	42 037 925
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP BCP 05JUN 365D 0.1200% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		10 500	15 010 500
DP DP BCP 12JUL 365D 0.1800% 2018-07-12 a 2019-07-12			EUR		4 325	5 004 325
DP DP SANTANDER 05JUN 0.1800% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		23 100	22 023 100
						42 037 925
						52 584 698

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						51 025
Valores Passivos						-168 782
						-117 757
						214 970 030

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

OE99 EUR EUX 03/19	-45	132.52	EUR	132.52		-5 963 400
--------------------	-----	--------	-----	--------	--	------------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

36 714 924.51

Valor da Unidade de Participação: € 5.8551