

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-02-28

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.					5 900	463 170
Titulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	330 000	122.16%	EUR	122.16%	5 684	408 795
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	103.25%	EUR	103.25%	216	41 517
Acções						
EDP Renováveis	1 792	7.18	EUR	7.18		12 858
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						78 117
Titulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	78 000	100.15%	EUR	100.15%		78 117
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					37 360	11 059 336
Titulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	230 000	135.57%	EUR	135.57%	2 205	314 005
DBR 5.5% 01/04/31	250 000	157.02%	EUR	157.02%	2 110	394 652
DBR 2.5% 07/2044	192 000	127.92%	EUR	127.92%	3 156	248 761
DBR 1.5% 02/2023	45 000	107.58%	EUR	107.58%	26	48 438
DBR 1.75% 2/2024	130 000	109.44%	EUR	109.44%	87	142 357
BKO 0% 09/18	1 030 000	100.30%	EUR	100.30%		1 033 059
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	158.69%	EUR	158.69%	4 968	211 262
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	135.43%	EUR	135.43%	748	41 378
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	123.77%	EUR	123.77%	400	130 361
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	106.98%	EUR	106.98%	5 124	208 379
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	142.25%	EUR	142.25%	1 378	72 502
SPGB 3.45% 07/66	51 000	115.26%	EUR	115.26%	1 032	59 815
SPGB 0.45% 10/22	286 000	100.28%	EUR	100.28%	427	287 230
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	119.78%	EUR	119.78%	294	96 117
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	106.73%	EUR	106.73%	106	5 443
BTPS 5.5% 09/2022	176 000	121.13%	EUR	121.13%	4 840	218 029
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	117.89%	EUR	117.89%	1 611	128 930
BTPS 4.5% 03/2024	138 000	118.92%	EUR	118.92%	3 105	167 216
BTPS 3.5% 03/2030	215 000	112.28%	EUR	112.28%	3 763	245 165
						4 053 097
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	100 000	100.88%	EUR	100.88%	19	100 901
ACAFP Float 04/22	100 000	101.87%	EUR	101.87%	50	101 923
MCFP Float 11/18	60 000	100.22%	EUR	100.22%		60 129
BNP Float 06/24	100 000	101.80%	EUR	101.80%	99	101 896
RENAUL Float 03/2022	100 000	101.40%	EUR	101.40%	73	101 471
RENAULT Float 11/24	50 000	100.91%	EUR	100.91%	8	50 463
ALDFP Float 11/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%	1	100 430
HSBC Float 09/22	100 000	101.43%	EUR	101.43%	66	101 492
LLOYDS Float 06/2024	100 000	101.69%	EUR	101.69%	88	101 777

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
HSBC 0.17% 10/23	100 000	100.57%	EUR	100.57%	26	100 598
SANTAN Float 03/22	100 000	102.51%	EUR	102.51%	134	102 648
BKTSM 1.25% 02/28	200 000	100.30%	EUR	100.30%	151	200 749
SCANIA Float 04/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%	8	100 438
BAC Float 05/23	100 000	101.49%	EUR	101.49%	30	101 523
MS Float 11/22	100 000	101.40%	EUR	101.40%	22	101 419
GM Float 05/21	100 000	101.05%	EUR	101.05%	17	101 070
T Float 09/2023	100 000	101.69%	EUR	101.69%	126	101 818
NDASS Float 09/21	100 000	101.40%	EUR	101.40%	30	101 434
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.45%	EUR	100.45%	11	100 462
VW Float 03/19	100 000	100.22%	EUR	100.22%	4	100 227
ALVGR Float 12/20	200 000	101.27%	EUR	101.27%	82	202 626
NYKRE Float 06/22	100 000	100.89%	EUR	100.89%	58	100 947
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.26%	EUR	100.26%	48	100 305
KBCBB Float 11/22	100 000	101.20%	EUR	101.20%	2	101 203
DLTAS 2008-1 A	77 921	100.06%	EUR	100.06%	3	77 967
SUMIBK Float 06/22	100 000	100.64%	EUR	100.64%	26	100 665
BCHINA Float 11/20	100 000	100.27%	EUR	100.27%	3	100 275
CAFP Float 03/2020	100 000	100.70%	EUR	100.70%	37	100 738
SANTAN Float 03/2020	100 000	101.02%	EUR	101.02%	65	101 084
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.66%	EUR	100.66%	8	100 663
UPS Float 07/2020	100 000	100.81%	EUR	100.81%	12	100 819
DE Float 04/20	100 000	100.51%	EUR	100.51%	2	100 509
GS Float 07/2022	75 000	102.67%	EUR	102.67%	48	77 050
GS Float 29/05/2020	75 000	101.06%	EUR	101.06%	1	75 799
BAC Float 05/2019	100 000	101.29%	EUR	101.29%	72	101 361
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.63%	EUR	100.63%		65 410
MMM Float 05/20	100 000	100.58%	EUR	100.58%		100 580
ANNGR Float 09/18	100 000	100.12%	EUR	100.12%	11	100 132
UNANA Float 06/18	100 000	100.08%	EUR	100.08%		100 075
ARRFP Float 01/2020	100 000	101.07%	EUR	101.07%	59	101 131
POHBK Float 03/20	100 000	100.53%	EUR	100.53%		100 529
SKYLN Float 04/20	100 000	101.17%	EUR	101.17%	68	101 241
VOD Float 02/2019	100 000	100.89%	EUR	100.89%	5	100 899
CAT Float 05/2018	100 000	100.04%	EUR	100.04%		100 044
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.67%	EUR	100.67%		151 011
MAERSK Float 03/19	100 000	101.51%	EUR	101.51%	257	101 770
ISPIM Float 04/2019	100 000	101.00%	EUR	101.00%	86	101 084
GE Float 01/2020	100 000	100.46%	EUR	100.46%	5	100 460
GIS Float 01/2020	100 000	101.03%	EUR	101.03%	49	101 076
BMW Float 03/2019	100 000	100.35%	EUR	100.35%	10	100 356
MCD Float 08/2019	100 000	100.38%	EUR	100.38%		100 378
						5 201 056
Ações						
SIEMENS	202	108.44	EUR	108.44		21 905
ALLIANZ	77	192.02	EUR	192.02		14 786
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 179	8.36	EUR	8.36		9 856

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BASF	414	86.41	EUR	86.41		35 774
BAYER AG	403	96.23	EUR	96.23		38 781
ADIDAS- SALOMON AG	198	182.60	EUR	182.60		36 155
SAP SE	297	86.20	EUR	86.20		25 601
LUFTHANSA	817	27.62	EUR	27.62		22 566
DEUTSCHE TELEKOM	981	13.26	EUR	13.26		13 008
DAIMLER CHRYSLER	720	70.47	EUR	70.47		50 738
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	22.40	EUR	22.40		33 152
DEUTSCHE POST	988	37.64	EUR	37.64		37 188
VOLKSWAGEN AG-PREF.	372	161.12	EUR	161.12		59 937
RHEINMETALL AG	308	109.00	EUR	109.00		33 572
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	67.10	EUR	67.10		35 899
1&1 Drillisch	439	63.45	EUR	63.45		27 855
COVESTRO AG	142	93.34	EUR	93.34		13 254
VONOVIA SE	233	37.55	EUR	37.55		8 749
DANONE	654	65.75	EUR	65.75		43 001
TOTAL SA	1 069	46.97	EUR	46.97		50 211
Kering	75	388.00	EUR	388.00		29 100
BNP	154	65.37	EUR	65.37		10 067
AIR LIQUIDE	176	103.15	EUR	103.15		18 154
SCHNEIDER	587	71.58	EUR	71.58		42 017
L.V.M.H.	217	246.50	EUR	246.50		53 491
ACCOR	315	47.50	EUR	47.50		14 963
BOUYGUES	452	41.66	EUR	41.66		18 830
GLE ENTREP. VINCI	513	81.32	EUR	81.32		41 717
SANOFI SYNHLABO	243	65.03	EUR	65.03		15 802
AIRBUS SE	203	98.34	EUR	98.34		19 963
LEGRAND PROMESSES	232	64.54	EUR	64.54		14 973
ARKEMA	96	107.45	EUR	107.45		10 315
SAFRAN SA	248	90.90	EUR	90.90		22 543
HSBC HOLDINGS	3 200	7.17	GBP	8.10		25 920
DIAGEO ORD.	344	24.60	GBP	27.79		9 559
3I GROUP	3 088	9.40	GBP	10.61		32 773
Imperial Brands PLC	298	26.19	GBP	29.58		8 816
RECKITT BENCKISER	168	57.76	GBP	65.24		10 961
OCADO GROUP PLC	1 605	5.53	GBP	6.25		10 029
SHIRE PLC	571	31.09	GBP	35.12		20 052
AMADEUS HOLDING SA	495	60.56	EUR	60.56		29 977
ROYAL DUTCH SHELL B	438	23.21	GBP	26.22		11 483
TELEFONICA	1 294	7.99	EUR	7.99		10 343
BCO SANTANDER C.HISP	12 038	5.67	EUR	5.67		68 219
IBERDROLA	2 906	6.08	EUR	6.08		17 657
REPSOL	747	14.71	EUR	14.71		10 985
INDITEX	344	24.96	EUR	24.96		8 586
MEDIOBANCA	3 210	9.85	EUR	9.85		31 631
BANCA INTESA	9 521	3.10	EUR	3.10		29 477
ENEL	4 172	4.78	EUR	4.78		19 938

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
FINECOBANK SPA	2 917	10.12	EUR	10.12		29 520
CATTOLICA ASSIC	3 932	9.79	EUR	9.79		38 494
ESSITY AKTIEBO-B	469	228.00	SEK	22.57		10 588
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	18.50	EUR	18.50		7 549
ING GROEP NV	4 518	14.48	EUR	14.48		65 412
UNILEVER NV-CVA	1 215	42.98	EUR	42.98		52 215
ASML NA	395	161.30	EUR	161.30		63 714
AKZO NOBEL NV NLG20	173	79.76	EUR	79.76		13 798
ABN AMRO GROUP NV	913	25.60	EUR	25.60		23 373
VESTAS WIND SYSTEMS	167	443.60	DKK	59.57		9 949
TDC A/S	4 420	49.75	DKK	6.68		29 530
ANHEUSER-BUSCH INB	676	87.48	EUR	87.48		59 136
OMV AG	278	47.10	EUR	47.10		13 094
ERST BK DER OEST.SPA	698	41.91	EUR	41.91		29 253
RAIFFEISEN INTL BK H	1 128	31.99	EUR	31.99		36 085
AIB GROUP PLC	3 763	5.40	EUR	5.40		20 320
ARCELOR MITTAL	808	28.25	EUR	28.25		22 826
						1 805 183
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					16	223 998
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	100.12%	EUR	100.12%	10	100 133
AGN Float 06/19	100 000	100.18%	EUR	100.18%	5	100 184
						200 318
Acções						
SUNRISE COM. GROUP	304	89.70	CHF	77.90		23 681
						11 824 621

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						3 690 589
CXG OBRIGAÇÕES	390 013	4.48	EUR	4.48		1 748 699
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.70	EUR	3.70		713 351
CXG PRIVATE EQUITY	21 147	5.94	EUR	5.94		125 526
CXG INFRAESTRUTURAS	33 755	6.80	EUR	6.80		229 591
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.34	EUR	5.34		602 102
F.LIMOB.IMOSOCIAL	16 827	5.21	EUR	5.21		87 603
FUNDIESTAMO I	58	1 034.42	EUR	1 034.42		59 996
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.25	EUR	10.25		73 840
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	2.97	EUR	2.97		49 879
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						8 292 936
BROCK EURO MKT Fd D2	35 038	32.96	EUR	32.96		1 154 852
Amundi Funds II-Eur	121 886	9.28	EUR	9.28		1 131 102
BANTLEON OPPORTUNIT	1 346	170.71	EUR	170.71		229 776
Janus Hend H. Pan Al	1 764	16.53	EUR	16.53		29 159
Schroder ISF Euro Eq	25 669	45.81	EUR	45.81		1 175 799
MERRILL LYNCH MARSH	469	142.56	EUR	142.56		66 861

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
JAN HND UK Abs Ret	9 278	7.17	EUR	7.17		66 512
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.70	EUR	1.70		45 096
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 341.89	EUR	1 341.89		50 992
SCH EUROP ALPHA ABS	431	106.47	EUR	106.47		45 890
LYXOR EPSILON GLOB E	281	129.90	EUR	129.90		36 502
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 777.71	EUR	1 777.71		1 111 069
Janus Hend Horiz Eur	77 610	14.57	EUR	14.57		1 130 778
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 031.80	EUR	1 031.80		115 562
DNCA INVEST-MIURA-I	181	133.17	EUR	133.17		24 104
AXA WF EUR SD-I-XC€	3 609	100.24	EUR	100.24		361 810
ISHARES STOXX EU 600	6 630	18.44	EUR	18.44		122 284
HYPO DJ ESTX 50 FRA	21 267	34.34	EUR	34.34		730 202
ISHARES S&P 500 MONT	10 733	61.92	EUR	61.92		664 587
OIC domici. em Estados não membros da EU						370 374
ISHARES MSCI EMER.MK	9 331	48.47	USD	39.69		370 374
						12 353 899

LIQUIDEZ

À vista						1 019 975
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			401
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			6 185
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			978 346
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 132
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			58
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			54
DO CGD - USD 0.0000%			USD			4 063
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			29 736
						1 019 975
						1 019 975

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						19 359
Valores Passivos						-48 916
						-29 557
						25 168 937

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

TYH8-USD CBT 03/18	-6	120.59	USD	98.77		-592 598
--------------------	----	--------	-----	-------	--	----------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

4 023 428.61

Valor da Unidade de Participação: € 6.2556