

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
<b>COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA</b>						
<b>VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS</b>						
Merc. Cot. Oficiais de Bolsa Val. Port.					20 668	1 503 475
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	1 200 000	122.16%	EUR	122.16%	20 668	1 486 528
Acções						
EDP Renováveis	2 362	7.18	EUR	7.18		16 947
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						407 611
Títulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	407 000	100.15%	EUR	100.15%		407 611
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					156 400	58 291 608
Títulos de Dívida Pública						
DBR 5.5% 01/04/31	500 000	157.02%	EUR	157.02%	4 219	789 304
DBR 4% 04/01/37	100 000	150.12%	EUR	150.12%	614	150 737
DBR 3% 07/2020	98 000	108.30%	EUR	108.30%	1 933	108 066
DBR 2.5% 07/2044	540 000	127.92%	EUR	127.92%	8 877	699 639
DBR 1.5% 02/2023	1 100 000	107.58%	EUR	107.58%	633	1 184 035
DBR 1.5% 05/2023	481 000	107.67%	EUR	107.67%	5 732	523 601
DBR 1.75% 2/2024	1 155 000	109.44%	EUR	109.44%	775	1 264 784
DBR 0.5% 08/27	500 000	99.08%	EUR	99.08%	1 575	496 965
BKO 0% 09/18	2 950 000	100.30%	EUR	100.30%		2 958 762
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	158.69%	EUR	158.69%	12 765	542 780
FRTR 3% 04/2022	960 000	112.78%	EUR	112.78%	24 460	1 107 177
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	135.43%	EUR	135.43%	7 355	406 882
SPGB 4.6% 07/2019	805 000	106.98%	EUR	106.98%	21 711	882 868
SPGB 5.15% 10/2044	250 000	151.86%	EUR	151.86%	4 268	383 923
SPGB 0.25% 04/2018	218 000	100.09%	EUR	100.09%	455	218 660
SPGB 3.45% 07/66	271 000	115.26%	EUR	115.26%	5 482	317 839
SPGB0.4% 04/22	290 000	100.47%	EUR	100.47%	969	292 338
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	100.28%	EUR	100.28%	1 824	1 228 261
BTPS 4.75% 08/2023	305 000	119.78%	EUR	119.78%	1 121	366 447
BTPS 5% 03/2025	514 000	123.43%	EUR	123.43%	12 850	647 290
BTPS 4.5% 05/2023	254 000	117.89%	EUR	117.89%	3 789	303 224
BTPS 4.5% 03/2024	400 000	118.92%	EUR	118.92%	9 000	484 684
BTPS 3.5% 03/2030	700 000	112.28%	EUR	112.28%	12 250	798 210
						16 156 477
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	100.88%	EUR	100.88%	211	1 109 913
VW Float 07/19	100 000	100.26%	EUR	100.26%	3	100 261
VW Float 07/21	200 000	100.42%	EUR	100.42%	35	200 865
ACAFP Float 04/22	700 000	101.87%	EUR	101.87%	349	713 460
MCFP Float 11/18	200 000	100.22%	EUR	100.22%		200 430
BNP Float 06/24	600 000	101.80%	EUR	101.80%	594	611 376
RENAUL Float 03/2022	400 000	101.40%	EUR	101.40%	293	405 885

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RENAULT Float 11/24	800 000	100.91%	EUR	100.91%	134	807 414
ALDFP Float 11/20	300 000	100.43%	EUR	100.43%	2	301 289
HSBC Float 09/22	350 000	101.43%	EUR	101.43%	231	355 222
RBS Float 06/20	500 000	100.51%	EUR	100.51%	120	502 685
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.69%	EUR	101.69%	877	1 017 767
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	100.57%	EUR	100.57%	261	1 005 981
RBS Float 03/2020	200 000	100.35%	EUR	100.35%		200 692
IBESM Float 02/24	700 000	100.91%	EUR	100.91%	60	706 428
SANTAN Float 03/22	1 000 000	102.51%	EUR	102.51%	1 344	1 026 484
BBVASM Float 04/22	1 000 000	101.36%	EUR	101.36%	361	1 013 941
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	100.30%	EUR	100.30%	301	401 497
SCANIA Float 10/18	100 000	100.17%	EUR	100.17%	2	100 173
SCANIA Float 04/20	300 000	100.43%	EUR	100.43%	23	301 313
SRGIM Float 08/24	1 000 000	100.20%	EUR	100.20%	54	1 002 084
MS Float 01/22	300 000	101.11%	EUR	101.11%	96	303 435
BAC Float 02/22	200 000	101.53%	EUR	101.53%	58	203 116
BAC Float 05/23	450 000	101.49%	EUR	101.49%	136	456 854
GM Float 05/21	800 000	101.05%	EUR	101.05%	133	808 557
T Float 09/2023	1 000 000	101.69%	EUR	101.69%	1 259	1 018 179
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.25%	EUR	100.25%		1 002 540
BATSLN Float 08/21	500 000	100.76%	EUR	100.76%	31	503 844
GS Float 09/23	300 000	100.32%	EUR	100.32%	155	301 100
NDASS Float 09/21	200 000	101.40%	EUR	101.40%	61	202 869
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.45%	EUR	100.45%	84	803 692
VW Float 03/19	200 000	100.22%	EUR	100.22%	7	200 453
MYL Float 05/20	200 000	100.25%	EUR	100.25%	5	200 509
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.43%	EUR	100.43%	3	602 571
AEGON 0.375% 11/24	100 000	98.14%	EUR	98.14%	103	98 244
ALVGR Float 12/20	500 000	101.27%	EUR	101.27%	205	506 565
SYDBDC Float 05/18	400 000	100.09%	EUR	100.09%	17	400 381
NYKRE Float 06/22	700 000	100.89%	EUR	100.89%	408	706 631
JYBC Float 06/20	400 000	100.43%	EUR	100.43%	20	401 748
KBCBB Float 11/22	400 000	101.20%	EUR	101.20%	7	404 811
DLTAS 2008-1 A	701 287	100.06%	EUR	100.06%	25	701 705
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.64%	EUR	100.64%	132	503 327
NAB Float 04/2021	300 000	101.52%	EUR	101.52%	83	304 646
BMO Float 09/21	200 000	101.22%	EUR	101.22%	60	202 496
BCHINA Float 11/20	400 000	100.27%	EUR	100.27%	11	401 099
BNFP Float 01/2020	700 000	100.46%	EUR	100.46%	1	703 242
CAFP Float 03/2020	800 000	100.70%	EUR	100.70%	296	805 904
BFCM Float 03/2019	700 000	100.74%	EUR	100.74%	540	705 748
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.66%	EUR	100.66%	53	704 638
DE Float 04/20	300 000	100.51%	EUR	100.51%	7	301 528
JPM Float 01/2020	300 000	100.98%	EUR	100.98%	58	303 004
ABBAY Float 05/2019	600 000	100.71%	EUR	100.71%	35	604 307
MS Float 11/19	250 000	101.06%	EUR	101.06%	23	252 676
GS Float 07/2022	600 000	102.67%	EUR	102.67%	381	616 401

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GS Float 29/05/2020	550 000	101.06%	EUR	101.06%	6	555 858
BAC Float 03/2018	300 000	100.00%	EUR	100.00%	268	300 268
BAC Float 05/2019	600 000	101.29%	EUR	101.29%	434	608 168
C Float 11/2019	700 000	100.81%	EUR	100.81%	73	705 743
CS Float 10/2019	700 000	100.70%	EUR	100.70%	104	704 976
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.63%	EUR	100.63%		201 260
MMM Float 05/20	600 000	100.58%	EUR	100.58%		603 480
ANNGR Float 09/18	200 000	100.12%	EUR	100.12%	23	200 265
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.71%	EUR	100.71%	580	806 228
UNANA Float 06/18	500 000	100.08%	EUR	100.08%		500 375
POHBK Float 03/20	500 000	100.53%	EUR	100.53%		502 645
RY Float 03/2019	300 000	100.47%	EUR	100.47%	65	301 469
SKYLN Float 04/20	300 000	101.17%	EUR	101.17%	203	303 722
CAT Float 05/2018	500 000	100.04%	EUR	100.04%		500 220
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.55%	EUR	100.55%		502 760
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.67%	EUR	100.67%		302 022
FDX Float 04/19	300 000	100.49%	EUR	100.49%	90	301 569
CAPFP Float 07/2018	300 000	100.06%	EUR	100.06%	252	300 429
VW Float 07/2018	200 000	100.10%	EUR	100.10%		200 190
ISPIM Float 04/2019	500 000	101.00%	EUR	101.00%	431	505 421
ISPIM Float 06/20	800 000	101.85%	EUR	101.85%	1 218	816 010
GE Float 01/2020	1 000 000	100.46%	EUR	100.46%	55	1 004 605
GIS Float 01/2020	400 000	101.03%	EUR	101.03%	196	404 304
MCD Float 08/2019	300 000	100.38%	EUR	100.38%		301 134
						39 755 096
Acções						
SIEMENS	314	108.44	EUR	108.44		34 050
ALLIANZ	102	192.02	EUR	192.02		19 586
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	8.36	EUR	8.36		12 991
BASF	531	86.41	EUR	86.41		45 884
BAYER AG	531	96.23	EUR	96.23		51 098
ADIDAS- SALOMON AG	260	182.60	EUR	182.60		47 476
SAP SE	392	86.20	EUR	86.20		33 790
LUFTHANSA	1 104	27.62	EUR	27.62		30 492
DEUTSCHE TELEKOM	1 294	13.26	EUR	13.26		17 158
DAIMLER CHRYSLER	930	70.47	EUR	70.47		65 537
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	22.40	EUR	22.40		44 240
DEUTSCHE POST	1 302	37.64	EUR	37.64		49 007
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	161.12	EUR	161.12		78 949
RHEINMETALL AG	405	109.00	EUR	109.00		44 145
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	67.10	EUR	67.10		47 104
1&1 Drillisch	578	63.45	EUR	63.45		36 674
COVESTRO AG	187	93.34	EUR	93.34		17 455
VONOVIA SE	307	37.55	EUR	37.55		11 528
DANONE	858	65.75	EUR	65.75		56 414
TOTAL SA	1 384	46.97	EUR	46.97		65 006
Kering	97	388.00	EUR	388.00		37 636

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BNP	204	65.37	EUR	65.37		13 335
AIR LIQUIDE	250	103.15	EUR	103.15		25 788
SCHNEIDER	767	71.58	EUR	71.58		54 902
L.V.M.H.	284	246.50	EUR	246.50		70 006
ACCOR	420	47.50	EUR	47.50		19 950
BOUYGUES	596	41.66	EUR	41.66		24 829
GLE ENTREP. VINCI	672	81.32	EUR	81.32		54 647
SANOFI SYNHLABO	311	65.03	EUR	65.03		20 224
AIRBUS SE	270	98.34	EUR	98.34		26 552
LEGRAND PROMESSES	305	64.54	EUR	64.54		19 685
ARKEMA	117	107.45	EUR	107.45		12 572
SAFRAN SA	323	90.90	EUR	90.90		29 361
HSBC HOLDINGS	4 222	7.17	GBP	8.10		34 198
DIAGEO ORD.	461	24.60	GBP	27.79		12 810
3I GROUP	4 075	9.40	GBP	10.61		43 248
Imperial Brands PLC	392	26.19	GBP	29.58		11 596
RECKITT BENCKISER	219	57.76	GBP	65.24		14 288
OCADO GROUP PLC	2 109	5.53	GBP	6.25		13 178
SHIRE PLC	753	31.09	GBP	35.12		26 443
AMADEUS HOLDING SA	640	60.56	EUR	60.56		38 758
ROYAL DUTCH SHELL B	620	23.21	GBP	26.22		16 254
TELEFONICA	1 706	7.99	EUR	7.99		13 636
BCO SANTANDER C.HISP	15 885	5.67	EUR	5.67		90 020
IBERDROLA	3 831	6.08	EUR	6.08		23 277
REPSOL	985	14.71	EUR	14.71		14 484
INDITEX	453	24.96	EUR	24.96		11 307
MEDIOBANCA	4 235	9.85	EUR	9.85		41 732
BANCA INTESA	12 563	3.10	EUR	3.10		38 895
ENEL	5 499	4.78	EUR	4.78		26 280
FINECOBANK SPA	3 936	10.12	EUR	10.12		39 832
CATTOLICA ASSIC	5 279	9.79	EUR	9.79		51 681
ESSITY AKTIEBO-B	619	228.00	SEK	22.57		13 974
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	18.50	EUR	18.50		9 954
ING GROEP NV	5 962	14.48	EUR	14.48		86 318
UNILEVER NV-CVA	1 602	42.98	EUR	42.98		68 846
ASML NA	521	161.30	EUR	161.30		84 037
AKZO NOBEL NV NLG20	227	79.76	EUR	79.76		18 106
ABN AMRO GROUP NV	1 204	25.60	EUR	25.60		30 822
VESTAS WIND SYSTEMS	220	443.60	DKK	59.57		13 106
TDC A/S	5 828	49.75	DKK	6.68		38 937
ANHEUSER-BUSCH INB	891	87.48	EUR	87.48		77 945
OMV AG	366	47.10	EUR	47.10		17 239
ERST BK DER OEST.SPA	949	41.91	EUR	41.91		39 773
RAIFFEISEN INTL BK H	1 516	31.99	EUR	31.99		48 497
AIB GROUP PLC	4 965	5.40	EUR	5.40		26 811
ARCELOR MITTAL	909	28.25	EUR	28.25		25 679

2 380 035

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					579	1 843 555
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.32%	EUR	100.32%		300 969
F Float 12/21	500 000	100.12%	EUR	100.12%	51	500 666
UBS Float 09/22	700 000	101.37%	EUR	101.37%	512	710 130
AGN Float 06/19	300 000	100.18%	EUR	100.18%	16	300 553
						1 812 318
Acções						
SUNRISE COM. GROUP	401	89.70	CHF	77.90		31 237
						62 046 249
<b>UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)</b>						
OIC domiciliados em Portugal						14 402 144
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.48	EUR	4.48		9 865 961
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.70	EUR	3.70		2 775 534
CXG PRIVATE EQUITY	50 512	5.94	EUR	5.94		299 834
CXG INFRAESTRUTURAS	116 657	6.80	EUR	6.80		793 466
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.34	EUR	5.34		667 350
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						27 119 211
MS EUROCORP DURHED Z	180 722	30.12	EUR	30.12		5 443 347
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	32.96	EUR	32.96		1 855 714
Amundi Funds II-Eur	195 755	9.28	EUR	9.28		1 816 606
BANTLEON OPPORTUNIT	6 378	170.71	EUR	170.71		1 088 788
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.53	EUR	16.53		146 489
Schroder ISF Euro Eq	41 285	45.81	EUR	45.81		1 891 109
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	142.56	EUR	142.56		339 293
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.17	EUR	7.17		337 299
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.70	EUR	1.70		228 894
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 341.89	EUR	1 341.89		261 669
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	106.47	EUR	106.47		232 325
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	129.90	EUR	129.90		184 850
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 777.71	EUR	1 777.71		1 859 485
Janus Hend Horiz Eur	124 650	14.57	EUR	14.57		1 816 151
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 031.80	EUR	1 031.80		592 253
DNCA INVEST-MIURA-I	917	133.17	EUR	133.17		122 117
AXA WF EUR SD-I-XC€	42 529	100.24	EUR	100.24		4 263 072
ISHARES STOXX EU 600	31 470	18.44	EUR	18.44		580 433
HYPO DJ ESTX 50 FRA	59 232	34.34	EUR	34.34		2 033 731
ISHARES S&P 500 MONT	32 713	61.92	EUR	61.92		2 025 589
OIC domici. em Estados não membros da EU						1 170 477
TISHMAN ESO	91 579	0.26	EUR	0.26		23 750
ISHARES MSCI EMER.MK	28 890	48.47	USD	39.69		1 146 727
						42 691 832
<b>OUTROS ACTIVOS</b>						
Imóveis						

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
R Rodrigo Fonseca	5	426 340.00	EUR	426 340.00		2 131 700
REPUBLICA 35- R/C	8	671 837.50	EUR	671 837.50		5 374 700
						7 506 400
						7 506 400

LIQUIDEZ

À vista						4 559 487
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			268
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			8 212
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			4 365 809
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 318
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			102
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			48
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			13 183
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			170 527
						4 559 487
						4 559 487

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						20 264
Valores Passivos						-438 130
						-417 866
						116 386 103

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO  
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYH8-USD CBT 03/18	-17	120.59	USD	98.77		-1 679 028

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 603 765.16

Valor da Unidade de Participação: € 13.5273