

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-07-31

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.					2 026	334 821
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	313 000	99.66%	EUR	99.66%	2 026	313 965
Acções						
EDP Renováveis	2 362	8.83	EUR	8.83		20 856
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					172 488	64 297 408
Títulos de Dívida Pública						
DBR 5.5% 01/04/31	760 000	159.60%	EUR	159.60%	23 935	1 236 887
DBR 4% 04/01/37	1 000 000	154.45%	EUR	154.45%	22 904	1 567 374
DBR 3.25% 01/2020	1 900 000	105.59%	EUR	105.59%	35 358	2 041 549
DBR 3% 07/2020	998 000	106.93%	EUR	106.93%	2 297	1 069 438
DBR 2.5% 07/2044	600 000	133.90%	EUR	133.90%	1 151	804 539
DBR 1.5% 02/2023	1 100 000	108.04%	EUR	108.04%	7 549	1 195 989
DBR 1.5% 05/2023	481 000	108.29%	EUR	108.29%	1 542	522 402
DBR 1.75% 2/2024	455 000	110.35%	EUR	110.35%	3 643	505 722
BKO 0% 09/18	1 320 000	100.01%	EUR	100.01%		1 320 092
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	161.21%	EUR	161.21%	4 035	542 470
FRTR 3% 04/2022	960 000	112.16%	EUR	112.16%	7 733	1 084 469
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	138.68%	EUR	138.68%	1 786	410 880
SPGB 4.6% 07/2019	1 013 000	105.02%	EUR	105.02%	255	1 064 138
SPGB 5.15% 10/2044	250 000	155.13%	EUR	155.13%	9 665	397 478
SPGB 3.45% 07/66	271 000	118.42%	EUR	118.42%	51	320 969
SPGB0.4% 04/22	290 000	101.33%	EUR	101.33%	296	294 144
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	101.25%	EUR	101.25%	4 131	1 242 443
BTPS 4% 2/2037	700 000	111.45%	EUR	111.45%	14 000	794 115
BTPS 5% 03/2025	514 000	116.61%	EUR	116.61%	10 685	610 071
BTPS 4.5% 03/2024	220 000	112.48%	EUR	112.48%	4 116	251 581
						17 276 752
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	102.45%	EUR	102.45%	18	409 830
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	99.13%	EUR	99.13%	114	1 090 533
VW Float 07/19	200 000	100.07%	EUR	100.07%	4	200 150
VW Float 07/21	200 000	99.62%	EUR	99.62%	19	199 261
BASGR Float 11/19	200 000	100.30%	EUR	100.30%		200 602
SAPGR Float 03/21	300 000	100.44%	EUR	100.44%		301 329
VW Float 10/19	200 000	100.05%	EUR	100.05%	3	200 097
VW Float 12/21	200 000	100.31%	EUR	100.31%	114	200 742
ACAFP Float 04/22	900 000	100.66%	EUR	100.66%	144	906 066
MCFP Float 11/18	200 000	100.07%	EUR	100.07%		200 144
BNP Float 06/24	600 000	100.38%	EUR	100.38%	392	602 672
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.03%	EUR	100.03%	186	400 314
RENAULT Float 11/24	800 000	98.48%	EUR	98.48%	477	788 349

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ALDFP Float 11/20	300 000	100.00%	EUR	100.00%	57	300 063
BNP Float 05/23	500 000	99.81%	EUR	99.81%	290	499 360
HSBC Float 09/22	350 000	100.63%	EUR	100.63%	128	352 343
SANUK Float 05/23	200 000	99.79%	EUR	99.79%	189	199 777
RBS Float 06/20	500 000	100.06%	EUR	100.06%	82	500 367
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	100.02%	EUR	100.02%	520	1 000 690
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	99.81%	EUR	99.81%	134	998 214
RBS Float 03/2020	200 000	100.01%	EUR	100.01%	25	200 037
IBESM Float 02/24	700 000	100.88%	EUR	100.88%	482	706 649
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.10%	EUR	101.10%	794	1 011 804
BBVASM Float 04/22	1 100 000	100.40%	EUR	100.40%	171	1 104 560
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	101.05%	EUR	101.05%	2 397	406 601
SCANIA Float 10/18	100 000	100.06%	EUR	100.06%	1	100 057
SCANIA Float 04/20	300 000	100.18%	EUR	100.18%	8	300 551
SRGIM Float 08/24	1 000 000	98.50%	EUR	98.50%	179	985 149
FCABNK Float 06/21	100 000	98.81%	EUR	98.81%		98 814
MS Float 01/22	300 000	100.42%	EUR	100.42%	16	301 273
BAC Float 02/22	200 000	100.77%	EUR	100.77%	226	201 772
BAC Float 05/23	450 000	100.57%	EUR	100.57%	502	453 076
GM Float 05/21	800 000	100.50%	EUR	100.50%	649	804 657
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.12%	EUR	100.12%		1 001 220
BATSLN Float 08/21	500 000	99.94%	EUR	99.94%	186	499 886
GS Float 09/23	300 000	99.04%	EUR	99.04%	89	297 215
T Float 09/2023	1 000 000	100.97%	EUR	100.97%	852	1 010 592
C Float 03/23	500 000	99.97%	EUR	99.97%	101	499 926
GM Float 03/22	300 000	99.77%	EUR	99.77%	68	299 390
BAC FLOAT 04/24	400 000	99.92%	EUR	99.92%	29	399 713
NDASS Float 09/21	400 000	100.87%	EUR	100.87%	68	403 532
UBS Float 04/2021	500 000	100.55%	EUR	100.55%	22	502 752
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.19%	EUR	100.19%	858	802 394
VW Float 03/19	200 000	100.09%	EUR	100.09%	5	200 175
DAIGR Float 05/22	100 000	99.57%	EUR	99.57%		99 565
MYL Float 05/20	200 000	100.15%	EUR	100.15%	67	200 361
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.18%	EUR	100.18%	29	601 103
AEGON 0.375% 11/24	100 000	99.05%	EUR	99.05%	260	99 306
ALVGR Float 12/20	500 000	100.96%	EUR	100.96%	136	504 911
DAIGR Float 04/20	200 000	100.45%	EUR	100.45%	23	200 929
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.25%	EUR	100.25%	2	501 252
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.60%	EUR	100.60%	68	301 862
NYKRE Float 06/22	700 000	99.94%	EUR	99.94%	281	699 868
JYBC Float 06/20	400 000	100.31%	EUR	100.31%	19	401 239
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.30%	EUR	100.30%	107	401 287
KBCBB Float 11/22	400 000	99.85%	EUR	99.85%	173	399 557
DLTAS 2008-1 A	647 328	99.49%	EUR	99.49%	29	644 037
DE Float 09/20	100 000	100.20%	EUR	100.20%		100 195
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.76%	EUR	99.76%	86	498 891
MIZUHO Float 04/23	500 000	100.03%	EUR	100.03%	55	500 185

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
NAB Float 04/2021	300 000	101.11%	EUR	101.11%	27	303 348
BMO Float 09/21	200 000	100.57%	EUR	100.57%	33	201 165
BMO Float 03/22	200 000	100.53%	EUR	100.53%	48	201 114
BCHINA Float 11/20	400 000	99.90%	EUR	99.90%	114	399 706
BNFP Float 01/2020	700 000	100.28%	EUR	100.28%	3	701 935
CAFP Float 03/2020	800 000	100.36%	EUR	100.36%	175	803 079
BFCM Float 03/2019	700 000	100.43%	EUR	100.43%	324	703 313
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.47%	EUR	100.47%	14	703 304
UPS Float 07/2020	200 000	100.59%	EUR	100.59%	10	201 186
DE Float 04/20	300 000	100.32%	EUR	100.32%	2	300 971
JPM Float 01/2020	300 000	100.63%	EUR	100.63%	10	301 900
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.40%	EUR	100.40%	354	602 736
MS Float 11/19	250 000	100.68%	EUR	100.68%	187	251 877
GS Float 07/2022	600 000	101.60%	EUR	101.60%	68	609 668
GS Float 29/05/2020	750 000	100.79%	EUR	100.79%	503	756 413
BAC Float 05/2019	600 000	100.71%	EUR	100.71%	1 641	605 901
C Float 11/2019	700 000	100.51%	EUR	100.51%	356	703 926
CS Float 10/2019	700 000	100.45%	EUR	100.45%	40	703 190
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.41%	EUR	100.41%		200 814
MMM Float 05/20	800 000	100.45%	EUR	100.45%		803 584
ANNGR Float 09/18	200 000	100.02%	EUR	100.02%	16	200 054
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.38%	EUR	100.38%	312	803 360
POHBK Float 03/20	500 000	100.31%	EUR	100.31%		501 560
RY Float 03/2019	300 000	100.26%	EUR	100.26%	37	300 814
SKYLN Float 04/20	300 000	100.78%	EUR	100.78%	107	302 459
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.33%	EUR	100.33%		501 665
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.42%	EUR	100.42%		301 272
FDX Float 04/19	300 000	100.29%	EUR	100.29%	40	300 910
ISPIM Float 04/2019	500 000	100.18%	EUR	100.18%	152	501 067
ISPIM Float 06/20	800 000	100.09%	EUR	100.09%	761	801 473
GE Float 01/2020	1 000 000	100.25%	EUR	100.25%	15	1 002 555
GIS Float 01/2020	400 000	100.83%	EUR	100.83%	73	403 385
MCD Float 08/2019	300 000	100.23%	EUR	100.23%		300 699
						44 167 819
Acções						
SIEMENS	895	120.76	EUR	120.76		108 080
ALLIANZ	102	189.14	EUR	189.14		19 292
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.64	EUR	9.64		14 987
BASF	587	82.16	EUR	82.16		48 228
BAYER AG	579	95.26	EUR	95.26		55 156
ADIDAS- SALOMON AG	222	189.15	EUR	189.15		41 991
SAP SE	392	99.85	EUR	99.85		39 141
DEUTSCHE TELEKOM	1 833	14.15	EUR	14.15		25 937
DAIMLER CHRYSLER	377	59.15	EUR	59.15		22 300
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	22.66	EUR	22.66		44 754
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	152.22	EUR	152.22		74 588

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LEONI AG	987	43.57	EUR	43.57		43 004
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	66.02	EUR	66.02		46 346
COVESTRO AG	187	82.10	EUR	82.10		15 353
VONOVIA SE	1	41.41	EUR	41.41		41
DANONE	747	67.21	EUR	67.21		50 206
PERNOD RICARD	90	137.95	EUR	137.95		12 416
TOTAL SA	2 134	55.86	EUR	55.86		119 205
Kering	107	456.00	EUR	456.00		48 792
PEUGEOT CITROEN	2 447	24.61	EUR	24.61		60 221
BNP	204	55.67	EUR	55.67		11 357
AIR LIQUIDE	250	109.50	EUR	109.50		27 375
SCHNEIDER	213	68.84	EUR	68.84		14 663
L.V.M.H.	298	298.85	EUR	298.85		89 057
ORANGE	3 300	14.62	EUR	14.62		48 230
GLE ENTREP. VINCI	245	86.00	EUR	86.00		21 070
SANOFI SYNHLABO	311	74.37	EUR	74.37		23 129
AIRBUS SE	623	106.00	EUR	106.00		66 038
ARKEMA	117	107.25	EUR	107.25		12 548
SAFRAN SA	505	106.05	EUR	106.05		53 555
3I GROUP	2 384	9.48	GBP	10.63		25 333
RECKITT BENCKISER	219	67.97	GBP	76.22		16 692
WEIR GROUP PLC	971	19.49	GBP	21.85		21 217
OCADO GROUP PLC	2 109	11.06	GBP	12.40		26 157
ADMIRAL GROUP PLC	2 085	19.81	GBP	22.21		46 318
ASHTED GROUP PLC	842	23.41	GBP	26.25		22 104
SHIRE PLC	753	43.51	GBP	48.79		36 740
AMADEUS HOLDING SA	565	73.00	EUR	73.00		41 245
ROYAL DUTCH SHELL B	615	26.72	GBP	29.96		18 424
ROTORK PLC	5 663	3.60	GBP	4.04		22 855
TELEFONICA	5 042	7.69	EUR	7.69		38 778
BCO SANTANDER C.HISP	20 080	4.82	EUR	4.82		96 776
IBERDROLA	3 831	6.65	EUR	6.65		25 476
MASMOVIL IBERCOM	169	96.70	EUR	96.70		16 342
UNICREDITO ITALIANO	2 396	15.16	EUR	15.16		36 333
ENI SPA	722	16.46	EUR	16.46		11 887
BANCA INTESA	11 322	2.63	EUR	2.63		29 822
ENEL	4 661	4.77	EUR	4.77		22 233
ESSITY AKTIEBO-B	619	219.90	SEK	21.37		13 231
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	21.76	EUR	21.76		11 704
ING GROEP NV	5 284	13.10	EUR	13.10		69 231
UNILEVER NV-CVA	1 685	49.24	EUR	49.24		82 969
ASML NA	432	183.50	EUR	183.50		79 272
AKZO NOBEL NV NLG20	227	79.10	EUR	79.10		17 956
ABN AMRO GROUP NV	2 296	23.70	EUR	23.70		54 415
ASR NEDERLAND NV	1 275	38.30	EUR	38.30		48 833
EURONEXT NV	441	53.15	EUR	53.15		23 439
VESTAS WIND SYSTEMS	230	411.10	DKK	55.18		12 690

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ANHEUSER-BUSCH INB	960	86.59	EUR	86.59		83 126
ERST BK DER OEST.SPA	949	36.96	EUR	36.96		35 075
RAIFFEISEN INTL BK H	1 681	28.53	EUR	28.53		47 959
TENARIS SA	1 683	15.63	EUR	15.63		26 305
ARCELOR MITTAL	909	27.52	EUR	27.52		25 011
						2 443 008
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					364	1 800 959
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.16%	EUR	100.16%		300 480
F Float 12/21	500 000	99.29%	EUR	99.29%	42	496 497
UBS Float 09/22	700 000	100.48%	EUR	100.48%	308	703 689
AGN Float 06/19	300 000	100.09%	EUR	100.09%	15	300 294
						1 800 959
						66 433 188

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						14 368 579
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.45	EUR	4.45		9 801 709
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.82	EUR	3.82		2 861 501
CXG PRIVATE EQUITY	40 509	5.64	EUR	5.64		228 378
CXG INFRAESTRUTURAS	119 942	6.76	EUR	6.76		811 216
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.33	EUR	5.33		665 776
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						23 123 661
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	33.06	EUR	33.06		1 861 344
Amundi Funds II-Eur	195 755	9.69	EUR	9.69		1 896 866
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.75	EUR	16.75		148 439
Schroder ISF Euro Eq	41 285	46.44	EUR	46.44		1 917 069
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	144.64	EUR	144.64		344 243
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.25	EUR	7.25		341 280
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.65	EUR	1.65		222 343
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 343.78	EUR	1 343.78		262 037
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	103.98	EUR	103.98		226 889
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	126.31	EUR	126.31		179 738
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 869.55	EUR	1 869.55		1 955 549
Janus Hend Horiz Eur	124 650	14.83	EUR	14.83		1 848 560
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 023.65	EUR	1 023.65		587 575
DNCA INVEST-MIURA-I	917	124.03	EUR	124.03		113 736
MS EUROCORP BD-Z	180 722	29.42	EUR	29.42		5 316 841
HYPO DJ ESTX 50 FRA	75 052	35.81	EUR	35.81		2 687 612
ISHARES S&P 500 MONT	50 815	63.24	EUR	63.24		3 213 541
OIC domici. em Estados não membros da EU						25 065
TISHMAN ESOF	91 579	0.27	EUR	0.27		25 065
						37 517 305

OUTROS ACTIVOS

Imóveis

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-07-31

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						397 418
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			268
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			219
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			199 721
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			833
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			103
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			28
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			19 838
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			176 388
						397 418
						397 418

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						53 734
Valores Passivos						-126 598
						-72 864
						111 781 446

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYU8 USD CBT 09/18	-16	119.45	USD	102.06		-1 632 989

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 8 275 342.60

Valor da Unidade de Participação: € 13.5078