

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-05-31

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.					849	319 200
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	313 000	95.68%	EUR	95.68%	849	300 327
Acções						
EDP Renováveis	2 362	7.99	EUR	7.99		18 872
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						407 142
Títulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	407 000	100.04%	EUR	100.04%		407 142
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					195 015	63 602 750
Títulos de Dívida Pública						
DBR 5.5% 01/04/31	360 000	160.44%	EUR	160.44%	8 028	585 623
DBR 4% 04/01/37	1 000 000	155.01%	EUR	155.01%	16 219	1 566 329
DBR 3.25% 01/2020	1 900 000	106.37%	EUR	106.37%	25 038	2 046 087
DBR 3% 07/2020	998 000	107.70%	EUR	107.70%	27 233	1 102 069
DBR 2.5% 07/2044	600 000	134.15%	EUR	134.15%	13 644	818 526
DBR 1.5% 02/2023	1 100 000	108.65%	EUR	108.65%	4 792	1 199 920
DBR 1.5% 05/2023	481 000	108.85%	EUR	108.85%	336	523 880
DBR 1.75% 2/2024	455 000	110.83%	EUR	110.83%	2 312	506 584
BKO 0% 09/18	1 320 000	100.12%	EUR	100.12%		1 321 558
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	161.21%	EUR	161.21%	1 524	539 948
FRTR 3% 04/2022	960 000	112.73%	EUR	112.73%	2 919	1 085 137
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	137.75%	EUR	137.75%	184	406 540
SPGB 4.6% 07/2019	1 013 000	105.36%	EUR	105.36%	39 066	1 106 393
SPGB 5.15% 10/2044	250 000	149.88%	EUR	149.88%	7 513	382 213
SPGB 3.45% 07/66	271 000	113.38%	EUR	113.38%	7 838	315 084
SPGB0.4% 04/22	290 000	99.91%	EUR	99.91%	102	289 841
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	99.79%	EUR	99.79%	3 212	1 223 668
BTPS 4% 2/2037	700 000	111.33%	EUR	111.33%	9 282	788 571
BTPS 5% 03/2025	514 000	114.27%	EUR	114.27%	6 425	593 783
BTPS 4.5% 03/2024	220 000	110.15%	EUR	110.15%	2 475	244 805
						16 646 561
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	102.58%	EUR	102.58%	39	410 377
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	99.75%	EUR	99.75%	218	1 097 501
VW Float 07/19	200 000	100.13%	EUR	100.13%	7	200 261
VW Float 07/21	200 000	99.85%	EUR	99.85%	38	199 746
BASGR Float 11/19	200 000	100.36%	EUR	100.36%		200 720
SAPGR Float 03/21	300 000	100.52%	EUR	100.52%		301 557
VW Float 10/19	200 000	100.12%	EUR	100.12%	6	200 238
ACAFP Float 04/22	900 000	100.16%	EUR	100.16%	496	901 945
MCFP Float 11/18	200 000	100.13%	EUR	100.13%		200 254

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BNP Float 06/24	600 000	98.66%	EUR	98.66%	606	592 572
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.31%	EUR	100.31%	301	401 549
RENAULT Float 11/24	800 000	99.01%	EUR	99.01%	150	792 254
ALDFP Float 11/20	300 000	100.03%	EUR	100.03%	4	300 091
BNP Float 05/23	500 000	98.64%	EUR	98.64%	41	493 236
HSBC Float 09/22	350 000	100.39%	EUR	100.39%	238	351 593
SANUK Float 05/23	200 000	99.36%	EUR	99.36%	35	198 747
RBS Float 06/20	500 000	100.06%	EUR	100.06%	122	500 422
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	98.71%	EUR	98.71%	902	987 982
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	99.11%	EUR	99.11%	272	991 362
RBS Float 03/2020	200 000	100.05%	EUR	100.05%	37	200 143
IBESM Float 02/24	700 000	100.75%	EUR	100.75%	74	705 317
SANTAN Float 03/22	1 000 000	100.64%	EUR	100.64%	1 382	1 007 742
BBVASM Float 04/22	1 100 000	99.74%	EUR	99.74%	414	1 097 521
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	100.71%	EUR	100.71%	1 562	404 390
SCANIA Float 10/18	100 000	100.09%	EUR	100.09%	2	100 091
SCANIA Float 04/20	300 000	100.21%	EUR	100.21%	25	300 661
SRGIM Float 08/24	1 000 000	98.77%	EUR	98.77%	59	987 709
FCABNK Float 06/21	100 000	99.33%	EUR	99.33%	0	99 334
MS Float 01/22	300 000	100.23%	EUR	100.23%	109	300 805
BAC Float 02/22	200 000	100.57%	EUR	100.57%	66	201 206
BAC Float 05/23	450 000	100.04%	EUR	100.04%	158	450 356
GM Float 05/21	800 000	100.55%	EUR	100.55%	172	804 556
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.13%	EUR	100.13%		1 001 270
BATSLN Float 08/21	500 000	100.01%	EUR	100.01%	39	500 074
GS Float 09/23	300 000	98.84%	EUR	98.84%	162	296 682
T Float 09/2023	1 000 000	101.42%	EUR	101.42%	1 278	1 015 458
C Float 03/23	500 000	99.43%	EUR	99.43%	171	497 306
GM Float 03/22	300 000	99.82%	EUR	99.82%	123	299 577
BAC FLOAT 04/24	400 000	99.18%	EUR	99.18%	153	396 877
NDASS Float 09/21	400 000	100.83%	EUR	100.83%	125	403 449
UBS Float 04/2021	500 000	100.36%	EUR	100.36%	93	501 878
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.26%	EUR	100.26%	121	802 193
VW Float 03/19	200 000	100.11%	EUR	100.11%	7	200 223
DAIGR Float 05/22	100 000	100.03%	EUR	100.03%		100 033
MYL Float 05/20	200 000	100.10%	EUR	100.10%	8	200 210
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.22%	EUR	100.22%	4	601 330
AEGON 0.375% 11/24	100 000	98.97%	EUR	98.97%	197	99 167
ALVGR Float 12/20	500 000	100.95%	EUR	100.95%	207	504 942
DAIGR Float 04/20	200 000	100.56%	EUR	100.56%	49	201 165
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.45%	EUR	100.45%	11	502 247
NYKRE Float 06/22	700 000	100.17%	EUR	100.17%	430	701 606
JYBC Float 06/20	400 000	100.24%	EUR	100.24%	23	400 963
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.28%	EUR	100.28%	163	401 295
KBCBB Float 11/22	400 000	99.76%	EUR	99.76%	20	399 052
DLTAS 2008-1 A	668 912	99.73%	EUR	99.73%	33	667 166
DE Float 09/20	100 000	100.31%	EUR	100.31%		100 311

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.58%	EUR	99.58%	135	498 030
MIZUHO Float 04/23	500 000	99.50%	EUR	99.50%	124	497 634
NAB Float 04/2021	300 000	101.07%	EUR	101.07%	87	303 306
BMO Float 09/21	200 000	100.52%	EUR	100.52%	62	201 106
BMO Float 03/22	200 000	100.41%	EUR	100.41%	76	200 896
BCHINA Float 11/20	400 000	99.96%	EUR	99.96%	16	399 836
BNFP Float 01/2020	700 000	100.31%	EUR	100.31%	1	702 178
CAFP Float 03/2020	800 000	100.51%	EUR	100.51%	304	804 368
BFCM Float 03/2019	700 000	100.52%	EUR	100.52%	556	704 189
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.49%	EUR	100.49%	55	703 485
UPS Float 07/2020	200 000	100.62%	EUR	100.62%	26	201 260
DE Float 04/20	300 000	100.38%	EUR	100.38%	7	301 159
JPM Float 01/2020	300 000	100.67%	EUR	100.67%	65	302 078
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.46%	EUR	100.46%	50	602 810
MS Float 11/19	250 000	100.72%	EUR	100.72%	29	251 826
GS Float 07/2022	600 000	101.46%	EUR	101.46%	403	609 187
GS Float 29/05/2020	750 000	100.62%	EUR	100.62%	24	754 704
BAC Float 05/2019	600 000	100.95%	EUR	100.95%	491	606 191
C Float 11/2019	700 000	100.53%	EUR	100.53%	91	703 787
CS Float 10/2019	700 000	100.49%	EUR	100.49%	108	703 524
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.45%	EUR	100.45%		200 890
MMM Float 05/20	800 000	100.47%	EUR	100.47%		803 744
ANNGR Float 09/18	200 000	100.06%	EUR	100.06%	24	200 134
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.53%	EUR	100.53%	599	804 839
POHBK Float 03/20	500 000	100.31%	EUR	100.31%		501 570
RY Float 03/2019	300 000	100.32%	EUR	100.32%	67	301 033
SKYLN Float 04/20	300 000	100.85%	EUR	100.85%	207	302 742
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.35%	EUR	100.35%		501 745
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.40%	EUR	100.40%		301 212
FDX Float 04/19	300 000	100.34%	EUR	100.34%	94	301 123
CAPFP Float 07/2018	300 000	100.05%	EUR	100.05%	256	300 397
VW Float 07/2018	200 000	100.02%	EUR	100.02%		200 042
ISPIM Float 04/2019	500 000	100.18%	EUR	100.18%	451	501 366
ISPIM Float 06/20	800 000	99.55%	EUR	99.55%	1 253	797 637
GE Float 01/2020	1 000 000	100.27%	EUR	100.27%	56	1 002 746
GIS Float 01/2020	400 000	100.90%	EUR	100.90%	205	403 785
MCD Float 08/2019	300 000	100.26%	EUR	100.26%		300 792
						44 143 684
Acções						
SIEMENS	686	113.24	EUR	113.24		77 683
ALLIANZ	102	180.50	EUR	180.50		18 411
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.14	EUR	9.14		14 197
BASF	587	85.94	EUR	85.94		50 447
BAYER AG	531	102.70	EUR	102.70		54 534
ADIDAS- SALOMON AG	168	196.85	EUR	196.85		33 071
SAP SE	392	96.18	EUR	96.18		37 703
LUFTHANSA	1 104	23.66	EUR	23.66		26 121

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DEUTSCHE TELEKOM	1 833	13.33	EUR	13.33		24 434
DAIMLER CHRYSLER	1 105	62.87	EUR	62.87		69 471
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	23.84	EUR	23.84		47 084
DEUTSCHE POST	409	33.26	EUR	33.26		13 603
PUMA AG	11	486.00	EUR	486.00		5 346
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	164.14	EUR	164.14		80 429
RHEINMETALL AG	405	108.45	EUR	108.45		43 922
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	67.56	EUR	67.56		47 427
COVESTRO AG	187	77.50	EUR	77.50		14 493
VONOVIA SE	307	40.79	EUR	40.79		12 523
DANONE	747	66.74	EUR	66.74		49 855
PERNOD RICARD	90	144.45	EUR	144.45		13 001
TOTAL SA	1 884	51.90	EUR	51.90		97 780
Kering	137	487.70	EUR	487.70		66 815
BNP	204	54.24	EUR	54.24		11 065
AIR LIQUIDE	250	106.85	EUR	106.85		26 713
SCHNEIDER	383	73.68	EUR	73.68		28 219
L.V.M.H.	235	299.55	EUR	299.55		70 394
ACCOR	321	47.37	EUR	47.37		15 206
ORANGE	3 300	14.76	EUR	14.76		48 692
GLE ENTREP. VINCI	335	84.10	EUR	84.10		28 174
SANOFI SYNHLABO	311	66.10	EUR	66.10		20 557
AIRBUS SE	601	96.73	EUR	96.73		58 135
ARKEMA	117	104.85	EUR	104.85		12 267
HSBC HOLDINGS	4 222	7.26	GBP	8.27		34 927
3I GROUP	4 075	9.58	GBP	10.91		44 478
RECKITT BENCKISER	219	59.16	GBP	67.43		14 767
WEIR GROUP PLC	971	21.54	GBP	24.55		23 839
OCADO GROUP PLC	2 109	8.88	GBP	10.12		21 337
ASHTED GROUP PLC	842	23.01	GBP	26.23		22 083
SHIRE PLC	753	41.08	GBP	46.82		35 258
AMADEUS HOLDING SA	565	67.46	EUR	67.46		38 115
ROYAL DUTCH SHELL B	783	26.87	GBP	30.63		23 981
ROTORK PLC	5 663	3.36	GBP	3.83		21 669
TELEFONICA	5 042	7.63	EUR	7.63		38 450
BCO SANTANDER C.HISP	15 885	4.67	EUR	4.67		74 246
IBERDROLA	3 831	6.17	EUR	6.17		23 653
REPSOL	985	16.31	EUR	16.31		16 060
MASMOVIL IBERCOM	169	113.00	EUR	113.00		19 097
MEDIOBANCA	4 235	8.22	EUR	8.22		34 829
BANCA INTESA	11 322	2.52	EUR	2.52		28 543
ENEL	4 661	4.75	EUR	4.75		22 149
FINECOBANK SPA	3 540	8.47	EUR	8.47		29 977
CATTOLICA ASSIC	5 279	7.16	EUR	7.16		37 798
ESSITY AKTIEBO-B	619	229.70	SEK	22.36		13 843
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	19.77	EUR	19.77		10 634
ING GROEP NV	6 600	12.65	EUR	12.65		83 464

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UNILEVER NV-CVA	1 685	48.39	EUR	48.39		81 537
ASML NA	432	169.70	EUR	169.70		73 310
AKZO NOBEL NV NLG20	227	75.90	EUR	75.90		17 229
ABN AMRO GROUP NV	1 204	23.10	EUR	23.10		27 812
VESTAS WIND SYSTEMS	220	411.50	DKK	55.27		12 160
ANHEUSER-BUSCH INB	960	80.54	EUR	80.54		77 318
BPOST SA	1 601	15.21	EUR	15.21		24 351
OMV AG	591	49.20	EUR	49.20		29 077
ERST BK DER OEST.SPA	949	35.68	EUR	35.68		33 860
RAIFFEISEN INTL BK H	1 681	27.09	EUR	27.09		45 538
AIB GROUP PLC	4 965	4.81	EUR	4.81		23 872
ARCELOR MITTAL	909	27.61	EUR	27.61		25 097
						2 402 128
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					599	1 798 962
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.20%	EUR	100.20%		300 606
F Float 12/21	500 000	99.37%	EUR	99.37%	54	496 924
UBS Float 09/22	700 000	100.09%	EUR	100.09%	528	701 151
AGN Float 06/19	300 000	100.09%	EUR	100.09%	17	300 281
						1 798 962
						66 128 054

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						14 340 959
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.45	EUR	4.45		9 802 589
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.79	EUR	3.79		2 838 266
CXG PRIVATE EQUITY	40 509	5.58	EUR	5.58		226 056
CXG INFRAESTRUTURAS	119 942	6.74	EUR	6.74		808 709
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.33	EUR	5.33		665 339
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						21 727 173
MS EUROCORP DURHED Z	180 722	29.19	EUR	29.19		5 275 275
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	32.67	EUR	32.67		1 839 386
Amundi Funds II-Eur	195 755	9.61	EUR	9.61		1 881 206
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.73	EUR	16.73		148 261
Schroder ISF Euro Eq	41 285	45.72	EUR	45.72		1 887 509
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	145.50	EUR	145.50		346 290
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.25	EUR	7.25		341 157
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.71	EUR	1.71		230 551
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 346.36	EUR	1 346.36		262 540
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	106.67	EUR	106.67		232 761
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	127.46	EUR	127.46		181 373
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 848.96	EUR	1 848.96		1 934 012
Janus Hend Horiz Eur	124 650	14.83	EUR	14.83		1 848 560
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 031.42	EUR	1 031.42		592 035
DNCA INVEST-MIURA-I	917	127.07	EUR	127.07		116 523
ISHARES STOXX EU 600	31 470	16.61	EUR	16.61		522 717

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
HYPO DJ ESTX 50 FRA	59 232	35.15	EUR	35.15		2 081 709
ISHARES S&P 500 MONT	32 713	61.30	EUR	61.30		2 005 307
OIC domici. em Estados não membros da EU						1 152 927
TISHMAN ESO	91 579	0.27	EUR	0.27		25 065
ISHARES MSCI EMER.MK	28 890	45.54	USD	39.04		1 127 862
						37 221 059

OUTROS ACTIVOS

Imóveis

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

Depósitos à ordem

DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			269
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			219
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			3 765 921
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			35 123
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			103
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			359
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			13 799
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			161 511
						3 977 325
						3 977 325

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos

Valores Passivos

26 592
-235 138
-208 547
114 624 291

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

TYM8 USD CBT 06/18	-17	120.53	USD	103.33		-1 756 563
--------------------	-----	--------	-----	--------	--	------------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 512 055.68

Valor da Unidade de Participação: € 13.4661