

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2017-10-31

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.					3 603	454 502
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	80 000	122.20%	EUR	122.20%	76	97 838
OT 4.125% 04/2027	62 000	117.41%	EUR	117.41%	2 011	74 806
						172 643
Obrigações diversas						
SANTAN 1.625% 06/19	100 000	102.77%	EUR	102.77%	637	103 404
CXGD 1% 01/2022	100 000	101.95%	EUR	101.95%	762	102 714
RENEPL Float 20	60 000	104.83%	EUR	104.83%	118	63 018
						269 136
Acções						
EDP Renováveis	1 792	7.10	EUR	7.10		12 723
Outros Merc. Regulamentados Nacionais					4	78 008
Títulos de Dívida Pública						
BT 17NOV2017	78 000	100.01%	EUR	100.01%	4	78 008
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					63 417	11 157 856
Títulos de Dívida Pública						
DBR 4.75% 98/2028	209 000	145.28%	EUR	145.28%	3 264	306 901
DBR 6.25% 01/2024	130 000	139.81%	EUR	139.81%	6 700	188 447
DBR 5.5% 01/04/31	40 000	161.95%	EUR	161.95%	1 814	66 593
DBR 4% 01/2018	830 000	100.81%	EUR	100.81%	27 379	864 118
DBR 2.5% 07/2044	148 000	131.28%	EUR	131.28%	1 216	195 506
DBR 1.5% 02/2023	33 000	109.66%	EUR	109.66%	351	36 537
OBL 0.5% 02/2018	53 000	100.38%	EUR	100.38%	182	53 381
DBR 1.75% 2/2024	130 000	112.09%	EUR	112.09%	1 614	147 330
DBR 0.5% 08/27	148 000	101.31%	EUR	101.31%	223	150 168
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	160.57%	EUR	160.57%	3 045	211 790
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	135.89%	EUR	135.89%	427	41 194
FRTR 1.75% 11/2024	186 000	111.22%	EUR	111.22%	3 041	209 918
FRTR 0.25% 11/26	70 000	97.63%	EUR	97.63%	163	68 501
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	108.56%	EUR	108.56%	2 251	208 522
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	139.23%	EUR	139.23%	605	70 218
SPGB 4.4% 10/2023	137 000	122.56%	EUR	122.56%	17	167 925
SPGB 3.45% 07/66	51 000	110.07%	EUR	110.07%	453	56 589
SPGB0.4% 04/22	149 000	100.85%	EUR	100.85%	302	150 564
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	121.89%	EUR	121.89%	950	98 461
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	108.19%	EUR	108.19%	36	5 445
BTPS 5.5% 09/2022	176 000	123.23%	EUR	123.23%	1 631	218 519
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	119.71%	EUR	119.71%	2 430	131 711
BTPS 4.5% 03/2024	138 000	120.95%	EUR	120.95%	1 046	167 956
BTPS 3.5% 03/2030	15 000	114.83%	EUR	114.83%	88	17 313
TB 0.826% 02/2018	90 000	99.72%	USD	99.72%	472	77 453

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						3 911 062
Obrigações diversas						
BCPPL 0.75% 05/22	100 000	101.12%	EUR	101.12%	316	101 433
DAIGR Float 07/24	100 000	100.44%	EUR	100.44%	10	100 452
ACAFP Float 04/22	100 000	102.17%	EUR	102.17%	16	102 182
MCFP Float 11/18	60 000	100.30%	EUR	100.30%		60 179
BNP Float 06/24	100 000	101.81%	EUR	101.81%	64	101 869
RENAUL Float 03/2022	100 000	101.33%	EUR	101.33%	45	101 374
HSBC Float 09/22	100 000	101.49%	EUR	101.49%	36	101 530
LLOYDS Float 06/2024	100 000	101.81%	EUR	101.81%	51	101 864
SANTAN Float 03/22	100 000	101.79%	EUR	101.79%	79	101 867
SCANIA Float 04/20	100 000	100.39%	EUR	100.39%	2	100 394
BAC Float 05/23	100 000	101.36%	EUR	101.36%	111	101 471
MS Float 11/22	100 000	101.18%	EUR	101.18%	88	101 268
T Float 09/2023	100 000	102.83%	EUR	102.83%	82	102 908
NDASS Float 09/21	100 000	101.48%	EUR	101.48%	17	101 496
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.61%	EUR	100.61%	107	100 715
LANSNA 0.875% 02/27	100 000	100.33%	EUR	100.33%	621	100 949
VW Float 03/19	100 000	100.18%	EUR	100.18%	2	100 178
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.36%	EUR	100.36%	29	100 384
KBCBB Float 11/22	100 000	101.07%	EUR	101.07%	43	101 116
DLTAS 2008-1 A	82 704	99.41%	EUR	99.41%	4	82 220
CGD S.758 12/2017	650 000	99.87%	EUR	99.87%	994	650 159
NDB 0.25% 08/21	100 000	100.62%	EUR	100.62%	48	100 666
SUMIBK Float 06/22	100 000	100.64%	EUR	100.64%	16	100 651
CAFP Float 03/2020	100 000	100.66%	EUR	100.66%	22	100 680
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.99%	EUR	100.99%	44	101 033
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.71%	EUR	100.71%	2	100 713
UPS Float 07/2020	100 000	100.80%	EUR	100.80%	4	100 805
DE Float 04/20	100 000	100.47%	EUR	100.47%	1	100 472
GS Float 07/2022	75 000	102.63%	EUR	102.63%	8	76 983
GS Float 29/05/2020	75 000	101.08%	EUR	101.08%	49	75 856
BAC Float 05/2019	100 000	101.68%	EUR	101.68%	273	101 951
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.54%	EUR	100.54%		65 348
MMM Float 05/20	100 000	100.53%	EUR	100.53%		100 528
ANNGR Float 09/18	100 000	100.15%	EUR	100.15%	7	100 159
UNANA Float 06/18	100 000	100.17%	EUR	100.17%		100 168
ARRFP Float 01/2020	100 000	101.18%	EUR	101.18%	30	101 212
POHBK Float 03/20	100 000	100.59%	EUR	100.59%		100 589
SKYLN Float 04/20	100 000	101.20%	EUR	101.20%	35	101 236
VOD Float 02/2019	100 000	101.15%	EUR	101.15%	117	101 267
CAT Float 05/2018	100 000	100.09%	EUR	100.09%		100 091
UCGIM Float 12/2017	50 000	100.23%	EUR	100.23%	97	50 210
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.70%	EUR	100.70%		151 053
MAERSK Float 03/19	100 000	101.91%	EUR	101.91%	155	102 068
F Float 02/2018	100 000	100.08%	EUR	100.08%	33	100 108
ISPIM Float 04/2019	100 000	101.28%	EUR	101.28%	30	101 307

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GE Float 01/2020	100 000	100.62%	EUR	100.62%	1	100 621
GIS Float 01/2020	100 000	101.30%	EUR	101.30%	18	101 313
BMW Float 03/2019	100 000	100.37%	EUR	100.37%	6	100 374
MCD Float 08/2019	100 000	100.36%	EUR	100.36%		100 363
						5 353 834
Ações						
SIEMENS	572	122.50	EUR	122.50		70 070
ALLIANZ	171	199.35	EUR	199.35		34 089
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 179	10.13	EUR	10.13		11 943
BASF	356	93.62	EUR	93.62		33 329
BAYER AG	403	111.70	EUR	111.70		45 015
SAP SE	297	97.66	EUR	97.66		29 005
LUFTHANSA	997	27.40	EUR	27.40		27 318
DEUTSCHE TELEKOM	2 750	15.64	EUR	15.64		43 010
DAIMLER CHRYSLER	720	71.29	EUR	71.29		51 329
THYSEN KRUPP	421	22.91	EUR	22.91		9 643
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	23.51	EUR	23.51		34 787
VOLKSWAGEN AG-PREF.	160	155.90	EUR	155.90		24 944
RHEINMETALL AG	112	101.49	EUR	101.49		11 367
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	71.71	EUR	71.71		38 365
DEUTSCHE WOHNEN	319	36.57	EUR	36.57		11 664
ZALANDO SE	361	42.96	EUR	42.96		15 507
FRAPORT AG	234	81.46	EUR	81.46		19 062
DANONE	654	70.14	EUR	70.14		45 872
AXA-UAP	1 555	25.93	EUR	25.93		40 321
TOTAL SA	1 419	47.87	EUR	47.87		67 928
Kering	87	393.50	EUR	393.50		34 235
BNP	541	67.04	EUR	67.04		36 269
AIR LIQUIDE	111	109.30	EUR	109.30		12 132
SCHNEIDER	627	75.45	EUR	75.45		47 307
L.V.M.H.	251	256.10	EUR	256.10		64 281
GLE ENTREP. VINCI	555	84.05	EUR	84.05		46 648
SANOFI SYNHLABO	243	81.29	EUR	81.29		19 753
ARKEMA	136	108.45	EUR	108.45		14 749
ILIAD SA	66	214.35	EUR	214.35		14 147
DIAGEO ORD.	344	25.72	GBP	29.29		10 077
3I GROUP	2 693	9.61	GBP	10.95		29 476
Imperial Brands PLC	298	30.71	GBP	34.97		10 422
RECKITT BENCKISER	168	67.35	GBP	76.71		12 887
OCADO GROUP PLC	2 608	2.88	GBP	3.28		8 546
SHIRE PLC	571	37.21	GBP	42.38		24 199
AMADEUS HOLDING SA	495	58.25	EUR	58.25		28 834
ROYAL DUTCH SHELL B	305	24.22	GBP	27.58		8 412
INFORMA PLC	1 371	6.97	GBP	7.94		10 884
BCO SANTANDER C.HISP	14 851	5.82	EUR	5.82		86 477
IBERDROLA	2 906	6.94	EUR	6.94		20 162

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
REPSOL	901	16.09	EUR	16.09		14 493
INDITEX	1 078	32.10	EUR	32.10		34 598
TELECOM ITALIA	12 820	0.75	EUR	0.75		9 551
BANCA INTESA	19 365	2.89	EUR	2.89		55 887
ENEL	4 172	5.33	EUR	5.33		22 216
Leonardo SpA	1 266	14.83	EUR	14.83		18 775
AZIMUT HOLDING SPA	1 921	16.96	EUR	16.96		32 580
BREMBO SAP	1 614	14.18	EUR	14.18		22 887
FINECOBANK SPA	1 877	8.03	EUR	8.03		15 072
ESSITY AKTIEBO-B	469	250.30	SEK	25.65		12 031
ALFA LAVAL AB	1 000	212.10	SEK	21.74		21 738
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	16.16	EUR	16.16		6 591
ING GROEP NV	4 355	15.86	EUR	15.86		69 070
UNILEVER NV-CVA	1 215	49.91	EUR	49.91		60 635
ASML NA	395	154.80	EUR	154.80		61 146
AKZO NOBEL NV NLG20	173	77.74	EUR	77.74		13 449
ALTICE NV A-W/I	972	16.20	EUR	16.20		15 742
ABN AMRO GROUP NV	1 526	26.52	EUR	26.52		40 462
VESTAS WIND SYSTEMS	258	563.50	DKK	75.73		19 537
FLSMIDTH & CO A/S	334	438.00	DKK	58.86		19 659
PANDORA A/S	243	603.00	DKK	81.03		19 691
ANHEUSER-BUSCH INB	676	105.05	EUR	105.05		71 014
CRH ORD	365	32.29	EUR	32.29		11 784
ARCELOR MITTAL	808	24.62	EUR	24.62		19 889
						1 892 960
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					3	129 825
Obrigações diversas						
AGN Float 06/19	100 000	100.15%	EUR	100.15%	3	100 156
Acções						
JULIUS BAER GROUP LT	337	59.00	CHF	50.75		17 103
SUNRISE COM. GROUP	176	83.00	CHF	71.40		12 566
						29 669
						11 820 191

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						2 734 199
CXG OBRIGAÇÕES	167 157	4.49	EUR	4.49		750 618
CXG IMOBILIARIO	198 914	3.67	EUR	3.67		729 577
CXG PRIVATE EQUITY	21 147	5.97	EUR	5.97		126 330
CXG INFRAESTRUTURAS	33 755	6.64	EUR	6.64		224 147
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.34	EUR	5.34		601 753
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	7.11	EUR	7.11		119 638
IBERIA F.INV.IMOB	4 595	0.00	EUR	0.00		0
FUNDIESTAMO I	58	1 042.35	EUR	1 042.35		60 456
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	9.84	EUR	9.84		70 915
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	3.02	EUR	3.02		50 764

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						8 726 482
SGAM FD ABSOL RETRN	17	1 072.17	EUR	1 072.17		18 227
BROCK EURO MKT Fd D2	33 634	33.86	EUR	33.86		1 138 847
PIONEER EUROLND EQ I	116 943	9.67	EUR	9.67		1 130 839
BANTLEON OPPORTUNIT	1 746	177.44	EUR	177.44		309 810
BNY MELLON ABS RET	20 006	1.18	EUR	1.18		23 693
AXA WF EU CREDIT	2 650	136.84	EUR	136.84		362 626
Natixis Tresorie I	28	12 543.11	EUR	12 543.11		351 207
HENDERSON HPE.ALPHA	1 764	16.83	EUR	16.83		29 688
Schroder ISF Euro Eq	24 663	45.93	EUR	45.93		1 132 826
Theadneedle Credit O	31 550	1.36	EUR	1.36		42 817
MERRILL LYNCH MARSH	469	146.08	EUR	146.08		68 512
PIONEER FUN RT CURRE	22	1 209.68	EUR	1 209.68		26 613
HENDERSON GART UK	9 278	7.27	EUR	7.27		67 467
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.70	EUR	1.70		45 258
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 308.86	EUR	1 308.86		49 737
SCH EUROP ALPHA ABS	431	109.51	EUR	109.51		47 199
LYXOR EPSILON GLOB E	281	120.96	EUR	120.96		33 989
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 843.24	EUR	1 843.24		1 152 025
MUZINICH LNG/SHT CRD	272	103.50	EUR	103.50		28 152
HENDERSON HORIZ.Euro	74 465	15.36	EUR	15.36		1 143 782
BNP PARIBAS MOIS IC	15	23 107.16	EUR	23 107.16		346 607
HYPO DJ ESTX 50 FRA	13 836	36.54	EUR	36.54		505 498
ISHARES S&P 500 MONT	11 479	58.46	EUR	58.46		671 062
						11 460 680
LIQUIDEZ						
À vista						1 857 392
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			392
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			305
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 846 832
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 234
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			58
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			56
DO CGD - USD 0.0000%			USD			844
DO RBS - USD Aj 0.0000%			USD			7 670
						1 857 392
						1 857 392
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						6 875
Valores Passivos						-26 602
						-19 727
						25 118 537
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYZ7-USD CBT 12/17	-6	124.95	USD	107.18		-643 094

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

3 963 634.02

Valor da Unidade de Participação: € 6.3372