

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-04-30

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.					6 823	472 013
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	262 000	123.49%	EUR	123.49%	6 680	330 218
PGB 2.25% 04/34	86 000	100.10%	EUR	100.10%	69	86 151
						416 370
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	103.26%	EUR	103.26%	74	41 379
Ações						
EDP Renováveis	1 792	7.96	EUR	7.96		14 264
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						78 066
Títulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	78 000	100.09%	EUR	100.09%		78 066
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					40 846	11 628 068
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	230 000	135.20%	EUR	135.20%	4 608	315 568
DBR 5.5% 01/04/31	270 000	158.09%	EUR	158.09%	4 760	431 592
DBR 3.25% 01/2020	600 000	106.55%	EUR	106.55%	6 251	645 545
DBR 2.5% 07/2044	197 000	129.95%	EUR	129.95%	4 061	260 063
DBR 1.5% 02/2023	45 000	107.79%	EUR	107.79%	139	48 643
DBR 1.75% 2/2024	130 000	109.78%	EUR	109.78%	467	143 179
BKO 0% 09/18	660 000	100.18%	EUR	100.18%		661 188
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	160.98%	EUR	160.98%	96	209 375
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	137.66%	EUR	137.66%	911	42 209
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	124.46%	EUR	124.46%	1 243	131 930
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	106.28%	EUR	106.28%	6 585	208 519
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	147.43%	EUR	147.43%	1 771	75 484
SPGB 3.45% 07/66	51 000	122.09%	EUR	122.09%	1 326	63 592
SPGB 0.45% 10/22	286 000	101.11%	EUR	101.11%	642	289 828
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	120.77%	EUR	120.77%	934	97 549
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	106.12%	EUR	106.12%	35	5 341
BTPS 5.5% 09/2022	176 000	121.58%	EUR	121.58%	1 605	215 582
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	118.74%	EUR	118.74%	2 430	130 670
BTPS 4.5% 03/2024	90 000	120.22%	EUR	120.22%	671	108 867
						4 084 724
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	102.65%	EUR	102.65%	2	51 328
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	100 000	100.17%	EUR	100.17%	9	100 180
BASGR Float 11/19	100 000	100.41%	EUR	100.41%		100 408
SAPGR Float 03/21	100 000	100.63%	EUR	100.63%		100 627
ACAFP Float 04/22	100 000	101.35%	EUR	101.35%	14	101 362
MCFP Float 11/18	60 000	100.16%	EUR	100.16%		60 095

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BNP Float 06/24	100 000	100.94%	EUR	100.94%	65	101 003
RENAUL Float 03/2022	100 000	100.88%	EUR	100.88%	46	100 923
RENAULT Float 11/24	50 000	99.96%	EUR	99.96%	29	50 007
ALDFP Float 11/20	100 000	100.26%	EUR	100.26%	18	100 277
HSBC Float 09/22	100 000	101.02%	EUR	101.02%	36	101 052
LLOYDS Float 06/2024	100 000	100.37%	EUR	100.37%	51	100 417
HSBC 0.17% 10/23	100 000	100.03%	EUR	100.03%	12	100 045
SANTAN Float 03/22	100 000	101.90%	EUR	101.90%	79	101 977
BKTSM 1.25% 02/28	200 000	101.29%	EUR	101.29%	568	203 152
SCANIA Float 04/20	100 000	100.25%	EUR	100.25%	2	100 256
BAC Float 05/23	100 000	100.74%	EUR	100.74%	107	100 847
MS Float 11/22	100 000	100.81%	EUR	100.81%	85	100 896
GM Float 05/21	100 000	100.74%	EUR	100.74%	76	100 818
T Float 09/2023	100 000	102.06%	EUR	102.06%	83	102 144
NDASS Float 09/21	100 000	101.20%	EUR	101.20%	17	101 215
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.33%	EUR	100.33%	102	100 428
VW Float 03/19	100 000	100.14%	EUR	100.14%	2	100 146
ALVGR Float 12/20	200 000	101.12%	EUR	101.12%	53	202 283
DAIGR Float 04/20	100 000	100.64%	EUR	100.64%	10	100 648
NYKRE Float 06/22	100 000	100.60%	EUR	100.60%	41	100 645
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.43%	EUR	100.43%	26	100 455
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.18%	EUR	100.18%	30	100 211
KBCBB Float 11/22	100 000	100.75%	EUR	100.75%	39	100 789
DLTAS 2008-1 A	75 523	100.00%	EUR	100.00%	3	75 526
SUMIBK Float 06/22	100 000	100.36%	EUR	100.36%	16	100 372
MIZUHO Float 04/23	100 000	100.34%	EUR	100.34%	10	100 348
BCHINA Float 11/20	100 000	100.00%	EUR	100.00%	27	100 023
CAFP Float 03/2020	100 000	100.59%	EUR	100.59%	22	100 607
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.84%	EUR	100.84%	43	100 880
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.58%	EUR	100.58%	2	100 586
UPS Float 07/2020	100 000	100.71%	EUR	100.71%	4	100 717
DE Float 04/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%	0	100 428
GS Float 07/2022	75 000	101.95%	EUR	101.95%	7	76 467
GS Float 29/05/2020	125 000	100.77%	EUR	100.77%	80	126 044
BAC Float 05/2019	100 000	101.12%	EUR	101.12%	264	101 380
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.52%	EUR	100.52%		65 341
MMM Float 05/20	100 000	100.54%	EUR	100.54%		100 544
ANNGR Float 09/18	100 000	100.08%	EUR	100.08%	7	100 084
UNANA Float 06/18	100 000	100.02%	EUR	100.02%		100 022
ARRFP Float 01/2020	100 000	100.94%	EUR	100.94%	29	100 965
POHBK Float 03/20	100 000	100.47%	EUR	100.47%		100 466
SKYLN Float 04/20	100 000	100.92%	EUR	100.92%	33	100 953
VOD Float 02/2019	100 000	100.71%	EUR	100.71%	111	100 820
CAT Float 05/2018	100 000	100.01%	EUR	100.01%		100 005
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.56%	EUR	100.56%		150 834
ISPIM Float 04/2019	100 000	100.81%	EUR	100.81%	28	100 835
GE Float 01/2020	100 000	100.31%	EUR	100.31%	1	100 312

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GIS Float 01/2020	100 000	100.97%	EUR	100.97%	17	100 991
BMW Float 03/2019	100 000	100.26%	EUR	100.26%	6	100 269
MCD Float 08/2019	100 000	100.34%	EUR	100.34%		100 340
						5 639 463
Ações						
SIEMENS	269	105.64	EUR	105.64		28 417
ALLIANZ	77	196.46	EUR	196.46		15 127
E.ON AG(EX VEB A AG)	1 179	9.07	EUR	9.07		10 696
BASF	414	86.32	EUR	86.32		35 736
BAYER AG	403	99.28	EUR	99.28		40 010
ADIDAS- SALOMON AG	127	203.90	EUR	203.90		25 895
SAP SE	297	92.42	EUR	92.42		27 449
LUFTHANSA	817	24.17	EUR	24.17		19 747
DEUTSCHE TELEKOM	1 390	14.50	EUR	14.50		20 148
DAIMLER CHRYSLER	839	65.50	EUR	65.50		54 955
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	21.28	EUR	21.28		31 494
DEUTSCHE POST	988	36.10	EUR	36.10		35 667
VOLKSWAGEN AG-PREF.	372	171.84	EUR	171.84		63 924
RHEINMETALL AG	308	108.65	EUR	108.65		33 464
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	63.34	EUR	63.34		33 887
COVESTRO AG	177	75.56	EUR	75.56		13 374
VONOVIA SE	233	41.61	EUR	41.61		9 695
DANONE	567	67.09	EUR	67.09		38 040
TOTAL SA	1 435	52.33	EUR	52.33		75 094
Kering	99	479.60	EUR	479.60		47 480
BNP	154	63.98	EUR	63.98		9 853
AIR LIQUIDE	209	108.05	EUR	108.05		22 582
SCHNEIDER	290	75.28	EUR	75.28		21 831
L.V.M.H.	178	289.30	EUR	289.30		51 495
ACCOR	311	46.87	EUR	46.87		14 577
ORANGE	2 372	15.12	EUR	15.12		35 853
GLE ENTREP. VINCI	254	83.10	EUR	83.10		21 107
SANOFI SYNHLABO	243	65.79	EUR	65.79		15 987
AIRBUS SE	456	97.40	EUR	97.40		44 414
ARKEMA	96	108.50	EUR	108.50		10 416
HSBC HOLDINGS	3 200	7.25	GBP	8.26		26 438
DIAGEO ORD.	344	25.89	GBP	29.49		10 144
3I GROUP	3 088	9.42	GBP	10.72		33 116
Imperial Brands PLC	298	26.05	GBP	29.66		8 840
RECKITT BENCKISER	168	57.02	GBP	64.94		10 910
OCADO GROUP PLC	1 605	5.38	GBP	6.13		9 842
ASHTREAD GROUP PLC	995	20.33	GBP	23.15		23 039
SHIRE PLC	571	38.66	GBP	44.03		25 142
AMADEUS HOLDING SA	429	60.70	EUR	60.70		26 040
ROYAL DUTCH SHELL B	594	26.02	GBP	29.63		17 600
ROTORK PLC	6 950	3.29	GBP	3.75		26 042

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TELEFONICA	3 826	8.43	EUR	8.43		32 265
BCO SANTANDER C.HISP	12 038	5.37	EUR	5.37		64 680
IBERDROLA	2 906	6.42	EUR	6.42		18 645
REPSOL	747	15.85	EUR	15.85		11 840
MASMOVIL IBERCOM	128	119.60	EUR	119.60		15 309
MEDIOBANCA	3 210	10.07	EUR	10.07		32 309
BANCA INTESA	8 591	3.16	EUR	3.16		27 122
ENEL	3 536	5.27	EUR	5.27		18 628
FINECOBANK SPA	2 917	9.90	EUR	9.90		28 890
CATTOLICA ASSIC	3 932	8.84	EUR	8.84		34 759
ESSITY AKTIEBO-B	469	223.00	SEK	21.07		9 883
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	20.01	EUR	20.01		8 162
ING GROEP NV	5 008	13.98	EUR	13.98		69 992
UNILEVER NV-CVA	1 154	47.45	EUR	47.45		54 757
ASML NA	327	157.50	EUR	157.50		51 503
AKZO NOBEL NV NLG20	173	74.90	EUR	74.90		12 958
ABN AMRO GROUP NV	913	25.73	EUR	25.73		23 491
VESTAS WIND SYSTEMS	167	400.20	DKK	53.71		8 970
ANHEUSER-BUSCH INB	676	82.72	EUR	82.72		55 919
BPOST SA	1 215	18.17	EUR	18.17		22 077
OMV AG	459	51.50	EUR	51.50		23 639
ERST BK DER OEST.SPA	698	40.60	EUR	40.60		28 339
RAIFFEISEN INTL BK H	1 276	28.00	EUR	28.00		35 728
AIB GROUP PLC	3 763	4.95	EUR	4.95		18 634
ARCELOR MITTAL	658	28.10	EUR	28.10		18 487
						1 852 552
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					11	200 050
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	99.90%	EUR	99.90%	7	99 902
AGN Float 06/19	100 000	100.14%	EUR	100.14%	4	100 148
						200 050
						12 378 198

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						3 681 412
CXG OBRIGAÇÕES	390 013	4.47	EUR	4.47		1 744 331
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.75	EUR	3.75		722 039
CXG PRIVATE EQUITY	22 736	5.54	EUR	5.54		126 064
CXG INFRAESTRUTURAS	34 705	6.63	EUR	6.63		230 025
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.34	EUR	5.34		601 640
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	5.25	EUR	5.25		88 266
FUNDIESTAMO I	58	1 045.23	EUR	1 045.23		60 623
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.34	EUR	10.34		74 556
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	2.02	EUR	2.02		33 868
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						7 792 510
BROCK EURO MKT Fd D2	35 038	32.92	EUR	32.92		1 153 451

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Amundi Funds II-Eur	121 886	9.62	EUR	9.62		1 172 543
Janus Hend H. Pan Al	1 764	16.63	EUR	16.63		29 335
Schroder ISF Euro Eq	25 669	46.11	EUR	46.11		1 183 480
MERRILL LYNCH MARSH	469	144.86	EUR	144.86		67 939
JAN HND UK Abs Ret	9 278	7.24	EUR	7.24		67 167
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.70	EUR	1.70		45 106
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 330.12	EUR	1 330.12		50 545
SCH EUROP ALPHA ABS	431	107.49	EUR	107.49		46 328
LYXOR EPSILON GLOB E	281	127.22	EUR	127.22		35 749
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 797.71	EUR	1 797.71		1 123 569
Janus Hend Horiz Eur	77 610	14.92	EUR	14.92		1 157 941
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 026.61	EUR	1 026.61		114 980
DNCA INVEST-MIURA-I	181	130.99	EUR	130.99		23 709
ISHARES STOXX EU 600	6 630	17.79	EUR	17.79		117 961
HYPO DJ ESTX 50 FRA	21 267	35.55	EUR	35.55		755 936
ISHARES S&P 500 MONT	10 733	60.26	EUR	60.26		646 771
OIC domici. em Estados não membros da EU						365 002
ISHARES MSCI EMER.MK	9 331	47.23	USD	39.12		365 002
						11 838 924

LIQUIDEZ

À vista						423 499
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			390
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			159
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			385 107
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			2 294
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			57
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			281
DO CGD - USD 0.0000%			USD			4 109
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			31 102
						423 499
						423 499

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						22 812
Valores Passivos						-97 428
						-74 616
						24 566 004

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYM8-USD CBT 06/18	-6	119.59	USD	99.05		-594 304

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					3 909 805.66	

Valor da Unidade de Participação: € 6.2832