

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
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.					459	138 335
Titulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	86 000	95.68%	EUR	95.68%	233	82 518
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	103.18%	EUR	103.18%	226	41 499
Acções						
EDP Renováveis	1 792	7.99	EUR	7.99		14 318
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						78 027
Titulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	78 000	100.04%	EUR	100.04%		78 027
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					50 259	11 684 885
Titulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	230 000	136.02%	EUR	136.02%	5 829	318 684
DBR 5.5% 01/04/31	40 000	160.44%	EUR	160.44%	892	65 069
DBR 4% 04/01/37	300 000	155.01%	EUR	155.01%	4 866	469 899
DBR 3.25% 01/2020	790 000	106.37%	EUR	106.37%	10 411	850 742
DBR 2.5% 07/2044	197 000	134.15%	EUR	134.15%	4 480	268 749
DBR 1.5% 02/2023	45 000	108.65%	EUR	108.65%	196	49 088
DBR 1.75% 2/2024	130 000	110.83%	EUR	110.83%	661	144 738
BKO 0% 09/18	500 000	100.12%	EUR	100.12%		500 590
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	161.21%	EUR	161.21%	593	210 160
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	137.75%	EUR	137.75%	19	41 343
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	121.96%	EUR	121.96%	1 671	129 726
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	105.36%	EUR	105.36%	7 327	207 517
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	140.08%	EUR	140.08%	1 970	72 011
SPGB 3.45% 07/66	51 000	113.38%	EUR	113.38%	1 475	59 296
SPGB 0.45% 10/22	286 000	99.79%	EUR	99.79%	751	286 156
BTPS 4% 2/2037	170 000	111.33%	EUR	111.33%	2 254	191 510
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	110.46%	EUR	110.46%	1 260	89 630
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	103.20%	EUR	103.20%	53	5 213
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	109.03%	EUR	109.03%	409	118 165
BTPS 4.5% 03/2024	90 000	110.15%	EUR	110.15%	1 013	100 148
SPGB 6% 31/01/2029	80 000	142.99%	EUR	142.99%	1 591	115 980
						4 294 413
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	102.58%	EUR	102.58%	5	51 297
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	100 000	99.75%	EUR	99.75%	20	99 773
BASGR Float 11/19	100 000	100.36%	EUR	100.36%		100 360
SAPGR Float 03/21	100 000	100.52%	EUR	100.52%		100 519
ACAFP Float 04/22	100 000	100.16%	EUR	100.16%	55	100 216
MCFP Float 11/18	60 000	100.13%	EUR	100.13%		60 076

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 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	100 000	98.66%	EUR	98.66%	101	98 762
RENAUL Float 03/2022	100 000	100.31%	EUR	100.31%	75	100 387
RENAULT Float 11/24	50 000	99.01%	EUR	99.01%	9	49 516
ALDFP Float 11/20	100 000	100.03%	EUR	100.03%	1	100 030
HSBC Float 09/22	100 000	100.39%	EUR	100.39%	68	100 455
LLOYDS Float 06/2024	100 000	98.71%	EUR	98.71%	90	98 798
HSBC 0.17% 10/23	100 000	99.11%	EUR	99.11%	27	99 136
SANTAN Float 03/22	100 000	100.64%	EUR	100.64%	138	100 774
BKTSM 1.25% 02/28	200 000	100.71%	EUR	100.71%	781	202 195
SCANIA Float 04/20	100 000	100.21%	EUR	100.21%	8	100 220
BAC Float 05/23	100 000	100.04%	EUR	100.04%	35	100 079
MS Float 11/22	100 000	100.07%	EUR	100.07%	25	100 095
GM Float 05/21	100 000	100.55%	EUR	100.55%	22	100 570
T Float 09/2023	100 000	101.42%	EUR	101.42%	128	101 546
MS Float 05/21	100 000	99.79%	EUR	99.79%	2	99 793
NDASS Float 09/21	100 000	100.83%	EUR	100.83%	31	100 862
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.26%	EUR	100.26%	15	100 274
VW Float 03/19	100 000	100.11%	EUR	100.11%	4	100 112
ALVGR Float 12/20	200 000	100.95%	EUR	100.95%	83	201 977
DAIGR Float 04/20	100 000	100.56%	EUR	100.56%	25	100 583
NYKRE Float 06/22	100 000	100.17%	EUR	100.17%	61	100 229
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.28%	EUR	100.28%	41	100 324
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.14%	EUR	100.14%	49	100 187
KBCBB Float 11/22	100 000	99.76%	EUR	99.76%	5	99 763
DLTAS 2008-1 A	74 324	99.73%	EUR	99.73%	4	74 130
SUMIBK Float 06/22	100 000	99.58%	EUR	99.58%	27	99 606
MIZUHO Float 04/23	100 000	99.50%	EUR	99.50%	25	99 527
BCHINA Float 11/20	100 000	99.96%	EUR	99.96%	4	99 959
CAFP Float 03/2020	100 000	100.51%	EUR	100.51%	38	100 546
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.51%	EUR	100.51%	67	100 574
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.49%	EUR	100.49%	8	100 498
UPS Float 07/2020	100 000	100.62%	EUR	100.62%	13	100 630
DE Float 04/20	100 000	100.38%	EUR	100.38%	2	100 386
GS Float 07/2022	75 000	101.46%	EUR	101.46%	50	76 148
GS Float 29/05/2020	125 000	100.62%	EUR	100.62%	4	125 784
BAC Float 05/2019	100 000	100.95%	EUR	100.95%	82	101 032
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.45%	EUR	100.45%		65 289
MMM Float 05/20	100 000	100.47%	EUR	100.47%		100 468
ANNGR Float 09/18	100 000	100.06%	EUR	100.06%	12	100 067
ARRFP Float 01/2020	100 000	100.85%	EUR	100.85%	61	100 913
POHBK Float 03/20	100 000	100.31%	EUR	100.31%		100 314
SKYLN Float 04/20	100 000	100.85%	EUR	100.85%	69	100 914
VOD Float 02/2019	100 000	100.62%	EUR	100.62%	12	100 628
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.40%	EUR	100.40%		150 606
ISPIM Float 04/2019	100 000	100.18%	EUR	100.18%	90	100 273
GE Float 01/2020	100 000	100.27%	EUR	100.27%	6	100 275
GIS Float 01/2020	100 000	100.90%	EUR	100.90%	51	100 946

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BMW Float 03/2019	100 000	100.21%	EUR	100.21%	11	100 223
MCD Float 08/2019	100 000	100.26%	EUR	100.26%		100 264
						5 517 610
Acções						
SIEMENS	499	113.24	EUR	113.24		56 507
ALLIANZ	77	180.50	EUR	180.50		13 899
E.ON AG(EX VEBAG)	1 179	9.14	EUR	9.14		10 771
BASF	414	85.94	EUR	85.94		35 579
BAYER AG	403	102.70	EUR	102.70		41 388
ADIDAS- SALOMON AG	127	196.85	EUR	196.85		25 000
SAP SE	297	96.18	EUR	96.18		28 565
LUFTHANSA	817	23.66	EUR	23.66		19 330
DEUTSCHE TELEKOM	1 390	13.33	EUR	13.33		18 529
DAIMLER CHRYSLER	839	62.87	EUR	62.87		52 748
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	23.84	EUR	23.84		35 283
DEUTSCHE POST	311	33.26	EUR	33.26		10 344
PUMA AG	8	486.00	EUR	486.00		3 888
VOLKSWAGEN AG-PREF.	372	164.14	EUR	164.14		61 060
RHEINMETALL AG	308	108.45	EUR	108.45		33 403
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	67.56	EUR	67.56		36 145
COVESTRO AG	177	77.50	EUR	77.50		13 718
VONOVIA SE	233	40.79	EUR	40.79		9 504
DANONE	567	66.74	EUR	66.74		37 842
PERNOD RICARD	70	144.45	EUR	144.45		10 112
TOTAL SA	1 435	51.90	EUR	51.90		74 477
Kering	99	487.70	EUR	487.70		48 282
BNP	154	54.24	EUR	54.24		8 353
AIR LIQUIDE	209	106.85	EUR	106.85		22 332
SCHNEIDER	290	73.68	EUR	73.68		21 367
L.V.M.H.	178	299.55	EUR	299.55		53 320
ACCOR	311	47.37	EUR	47.37		14 732
ORANGE	2 372	14.76	EUR	14.76		34 999
GLE ENTREP. VINCI	254	84.10	EUR	84.10		21 361
SANOFI SYNHLABO	243	66.10	EUR	66.10		16 062
AIRBUS SE	456	96.73	EUR	96.73		44 109
ARKEMA	96	104.85	EUR	104.85		10 066
HSBC HOLDINGS	3 200	7.26	GBP	8.27		26 473
3I GROUP	3 088	9.58	GBP	10.91		33 705
RECKITT BENCKISER	168	59.16	GBP	67.43		11 328
WEIR GROUP PLC	736	21.54	GBP	24.55		18 070
OCADO GROUP PLC	1 605	8.88	GBP	10.12		16 238
ASHTED GROUP PLC	638	23.01	GBP	26.23		16 733
SHIRE PLC	571	41.08	GBP	46.82		26 736
AMADEUS HOLDING SA	429	67.46	EUR	67.46		28 940
ROYAL DUTCH SHELL B	594	26.87	GBP	30.63		18 192
ROTORK PLC	4 294	3.36	GBP	3.83		16 430

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TELEFONICA	3 826	7.63	EUR	7.63		29 177
BCO SANTANDER C.HISP	12 038	4.67	EUR	4.67		56 266
IBERDROLA	2 906	6.17	EUR	6.17		17 942
REPSOL	747	16.31	EUR	16.31		12 180
MASMOVIL IBERCOM	128	113.00	EUR	113.00		14 464
MEDIOBANCA	3 210	8.22	EUR	8.22		26 399
BANCA INTESA	8 591	2.52	EUR	2.52		21 658
ENEL	3 536	4.75	EUR	4.75		16 803
FINECOBANK SPA	2 917	8.47	EUR	8.47		24 701
CATTOLICA ASSIC	3 932	7.16	EUR	7.16		28 153
ESSITY AKTIEBO-B	469	229.70	SEK	22.36		10 488
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	19.77	EUR	19.77		8 065
ING GROEP NV	5 008	12.65	EUR	12.65		63 331
UNILEVER NV-CVA	1 274	48.39	EUR	48.39		61 649
ASML NA	327	169.70	EUR	169.70		55 492
AKZO NOBEL NV NLG20	173	75.90	EUR	75.90		13 131
ABN AMRO GROUP NV	913	23.10	EUR	23.10		21 090
VESTAS WIND SYSTEMS	167	411.50	DKK	55.27		9 231
ANHEUSER-BUSCH INB	728	80.54	EUR	80.54		58 633
BPOST SA	1 215	15.21	EUR	15.21		18 480
OMV AG	459	49.20	EUR	49.20		22 583
ERST BK DER OEST.SPA	698	35.68	EUR	35.68		24 905
RAIFFEISEN INTL BK H	1 276	27.09	EUR	27.09		34 567
AIB GROUP PLC	3 763	4.81	EUR	4.81		18 093
ARCELOR MITTAL	658	27.61	EUR	27.61		18 167
						1 821 564
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					21	299 257
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	99.37%	EUR	99.37%	11	99 385
F Float 05/21	100 000	99.77%	EUR	99.77%	5	99 779
AGN Float 06/19	100 000	100.09%	EUR	100.09%	6	100 094
						299 257
						12 200 505

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						3 653 508
CXG OBRIGAÇÕES	390 013	4.45	EUR	4.45		1 737 467
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.79	EUR	3.79		729 474
CXG PRIVATE EQUITY	16 936	5.58	EUR	5.58		94 510
CXG INFRAESTRUTURAS	34 705	6.74	EUR	6.74		233 998
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.33	EUR	5.33		600 288
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	5.25	EUR	5.25		88 266
FUNDIESTAMO I	58	1 049.79	EUR	1 049.79		60 888
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.39	EUR	10.39		74 893
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	2.01	EUR	2.01		33 724
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						7 793 538

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BROCK EURO MKT Fd D2	35 038	32.67	EUR	32.67		1 144 691
Amundi Funds II-Eur	121 886	9.61	EUR	9.61		1 171 324
Janus Hend H. Pan Al	1 764	16.73	EUR	16.73		29 512
Schroder ISF Euro Eq	25 669	45.72	EUR	45.72		1 173 561
MERRILL LYNCH MARSH	469	145.50	EUR	145.50		68 240
JAN HND UK Abs Ret	9 278	7.25	EUR	7.25		67 273
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.71	EUR	1.71		45 422
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 346.36	EUR	1 346.36		51 162
SCH EUROP ALPHA ABS	431	106.67	EUR	106.67		45 976
LYXOR EPSILON GLOB E	281	127.46	EUR	127.46		35 816
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 848.96	EUR	1 848.96		1 155 600
Janus Hend Horiz Eur	77 610	14.83	EUR	14.83		1 150 956
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 031.42	EUR	1 031.42		115 519
DNCA INVEST-MIURA-I	181	127.07	EUR	127.07		23 000
ISHARES STOXX EU 600	6 630	16.61	EUR	16.61		110 124
HYPO DJ ESTX 50 FRA	21 267	35.15	EUR	35.15		747 429
ISHARES S&P 500 MONT	10 733	61.30	EUR	61.30		657 933
OIC domici. em Estados não membros da EU						364 281
ISHARES MSCI EMER.MK	9 331	45.54	USD	39.04		364 281
						11 811 327

LIQUIDEZ

À vista						1 202 025
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			404
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			159
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 147 490
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			24 304
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			58
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			290
DO CGD - USD 0.0000%			USD			4 253
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			25 067
						1 202 025
						1 202 025

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						23 357
Valores Passivos						-47 459
						-24 102
						25 189 755

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TYM8 USD CBT 06/18	-6	120.53	USD	103.33		-619 964

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 4 027 476.70

Valor da Unidade de Participação: € 6.2545