

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-06-30

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.					1 428	333 041
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	313 000	99.21%	EUR	99.21%	1 428	311 949
Acções						
EDP Renováveis	2 362	8.93	EUR	8.93		21 093
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						407 049
Títulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	407 000	100.01%	EUR	100.01%		407 049
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					235 955	64 320 699
Títulos de Dívida Pública						
DBR 5.5% 01/04/31	760 000	161.48%	EUR	161.48%	20 385	1 247 648
DBR 4% 04/01/37	1 000 000	156.44%	EUR	156.44%	19 507	1 583 857
DBR 3.25% 01/2020	1 900 000	106.01%	EUR	106.01%	30 114	2 044 228
DBR 3% 07/2020	998 000	107.42%	EUR	107.42%	29 694	1 101 726
DBR 2.5% 07/2044	600 000	135.87%	EUR	135.87%	14 877	830 079
DBR 1.5% 02/2023	1 100 000	108.68%	EUR	108.68%	6 148	1 201 650
DBR 1.5% 05/2023	481 000	108.95%	EUR	108.95%	929	524 959
DBR 1.75% 2/2024	455 000	111.04%	EUR	111.04%	2 967	508 185
BKO 0% 09/18	1 320 000	100.04%	EUR	100.04%		1 320 502
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	163.20%	EUR	163.20%	2 759	547 830
FRTR 3% 04/2022	960 000	112.84%	EUR	112.84%	5 287	1 088 560
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	140.38%	EUR	140.38%	972	415 084
SPGB 4.6% 07/2019	1 013 000	105.40%	EUR	105.40%	42 896	1 110 557
SPGB 5.15% 10/2044	250 000	154.21%	EUR	154.21%	8 572	394 099
SPGB 3.45% 07/66	271 000	117.53%	EUR	117.53%	8 607	327 102
SPGB0.4% 04/22	290 000	101.17%	EUR	101.17%	197	293 576
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	101.07%	EUR	101.07%	3 664	1 239 701
BTPS 4% 2/2037	700 000	112.52%	EUR	112.52%	11 602	799 228
BTPS 5% 03/2025	514 000	117.16%	EUR	117.16%	8 520	610 702
BTPS 4.5% 03/2024	220 000	112.89%	EUR	112.89%	3 282	251 640
						17 440 912
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	102.51%	EUR	102.51%	63	410 109
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	99.08%	EUR	99.08%	329	1 090 176
VW Float 07/19	200 000	100.06%	EUR	100.06%	11	200 139
VW Float 07/21	200 000	99.40%	EUR	99.40%	58	198 850
BASGR Float 11/19	200 000	100.30%	EUR	100.30%		200 600
SAPGR Float 03/21	300 000	100.45%	EUR	100.45%		301 362
VW Float 10/19	200 000	100.06%	EUR	100.06%	9	200 133
VW Float 12/21	200 000	100.10%	EUR	100.10%	48	200 250
ACAFP Float 04/22	900 000	100.31%	EUR	100.31%	850	903 640

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
MCFP Float 11/18	200 000	100.08%	EUR	100.08%		200 164
BNP Float 06/24	600 000	99.25%	EUR	99.25%	171	595 677
RENAUL Float 03/2022	400 000	99.85%	EUR	99.85%	66	399 474
RENAULT Float 11/24	800 000	98.23%	EUR	98.23%	311	786 183
ALDFP Float 11/20	300 000	100.02%	EUR	100.02%	30	300 099
BNP Float 05/23	500 000	99.04%	EUR	99.04%	163	495 343
HSBC Float 09/22	350 000	100.38%	EUR	100.38%	15	351 341
SANUK Float 05/23	200 000	99.54%	EUR	99.54%	111	199 195
RBS Float 06/20	500 000	99.97%	EUR	99.97%	35	499 905
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	99.29%	EUR	99.29%	127	993 037
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	99.29%	EUR	99.29%	416	993 346
RBS Float 03/2020	200 000	99.97%	EUR	99.97%	12	199 952
IBESM Float 02/24	700 000	100.74%	EUR	100.74%	274	705 468
SANTAN Float 03/22	1 000 000	100.90%	EUR	100.90%	194	1 009 174
BBVASM Float 04/22	1 100 000	100.09%	EUR	100.09%	662	1 101 674
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	101.57%	EUR	101.57%	1 973	408 245
SCANIA Float 10/18	100 000	100.07%	EUR	100.07%	4	100 074
SCANIA Float 04/20	300 000	100.20%	EUR	100.20%	43	300 646
SRGIM Float 08/24	1 000 000	98.49%	EUR	98.49%	118	984 968
FCABNK Float 06/21	100 000	98.73%	EUR	98.73%		98 729
MS Float 01/22	300 000	100.24%	EUR	100.24%	202	300 925
BAC Float 02/22	200 000	100.66%	EUR	100.66%	144	201 468
BAC Float 05/23	450 000	100.26%	EUR	100.26%	327	451 483
GM Float 05/21	800 000	100.48%	EUR	100.48%	407	804 223
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.12%	EUR	100.12%		1 001 190
BATSLN Float 08/21	500 000	99.89%	EUR	99.89%	111	499 571
GS Float 09/23	300 000	98.73%	EUR	98.73%	12	296 193
T Float 09/2023	1 000 000	101.10%	EUR	101.10%	397	1 011 407
C Float 03/23	500 000	99.61%	EUR	99.61%	25	498 060
GM Float 03/22	300 000	99.73%	EUR	99.73%	9	299 208
BAC FLOAT 04/24	400 000	99.48%	EUR	99.48%	277	398 197
NDASS Float 09/21	400 000	100.78%	EUR	100.78%	8	403 116
UBS Float 04/2021	500 000	100.42%	EUR	100.42%	165	502 265
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.23%	EUR	100.23%	484	802 340
VW Float 03/19	200 000	100.07%	EUR	100.07%	0	200 148
DAIGR Float 05/22	100 000	99.48%	EUR	99.48%		99 479
MYL Float 05/20	200 000	100.13%	EUR	100.13%	37	200 297
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.14%	EUR	100.14%	16	600 874
AEGON 0.375% 11/24	100 000	99.42%	EUR	99.42%	228	99 643
ALVGR Float 12/20	500 000	100.94%	EUR	100.94%	59	504 749
DAIGR Float 04/20	200 000	100.45%	EUR	100.45%	78	200 976
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.35%	EUR	100.35%	20	501 770
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.36%	EUR	100.36%	9	301 098
NYKRE Float 06/22	700 000	100.05%	EUR	100.05%	131	700 509
JYBC Float 06/20	400 000	100.25%	EUR	100.25%	9	400 989
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.28%	EUR	100.28%	46	401 170
KBCBB Float 11/22	400 000	99.48%	EUR	99.48%	95	398 007

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DLTAS 2008-1 A	658 120	99.61%	EUR	99.61%	30	655 570
DE Float 09/20	100 000	100.18%	EUR	100.18%		100 182
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.65%	EUR	99.65%	30	498 295
MIZUHO Float 04/23	500 000	99.75%	EUR	99.75%	195	498 935
NAB Float 04/2021	300 000	101.07%	EUR	101.07%	147	303 366
BMO Float 09/21	200 000	100.45%	EUR	100.45%	3	200 903
BMO Float 03/22	200 000	100.39%	EUR	100.39%	17	200 787
BCHINA Float 11/20	400 000	99.92%	EUR	99.92%	64	399 728
BNFP Float 01/2020	700 000	100.29%	EUR	100.29%	1	701 996
CAFP Float 03/2020	800 000	100.35%	EUR	100.35%	46	802 838
BFCM Float 03/2019	700 000	100.46%	EUR	100.46%	85	703 319
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.47%	EUR	100.47%	97	703 387
UPS Float 07/2020	200 000	100.57%	EUR	100.57%	43	201 187
DE Float 04/20	300 000	100.35%	EUR	100.35%	13	301 051
JPM Float 01/2020	300 000	100.64%	EUR	100.64%	120	302 037
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.43%	EUR	100.43%	199	602 785
MS Float 11/19	250 000	100.69%	EUR	100.69%	106	251 829
GS Float 07/2022	600 000	101.41%	EUR	101.41%	739	609 175
GS Float 29/05/2020	750 000	100.68%	EUR	100.68%	259	755 389
BAC Float 05/2019	600 000	100.83%	EUR	100.83%	1 057	606 049
C Float 11/2019	700 000	100.51%	EUR	100.51%	221	703 819
CS Float 10/2019	700 000	100.45%	EUR	100.45%	179	703 322
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.42%	EUR	100.42%		200 846
MMM Float 05/20	800 000	100.45%	EUR	100.45%		803 616
ANNGR Float 09/18	200 000	100.02%	EUR	100.02%	6	200 042
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.43%	EUR	100.43%	19	803 435
POHBK Float 03/20	500 000	100.30%	EUR	100.30%		501 490
RY Float 03/2019	300 000	100.27%	EUR	100.27%	4	300 823
SKYLN Float 04/20	300 000	100.74%	EUR	100.74%	312	302 529
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.33%	EUR	100.33%		501 650
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.40%	EUR	100.40%		301 206
FDX Float 04/19	300 000	100.32%	EUR	100.32%	149	301 094
ISPIM Float 04/2019	500 000	100.09%	EUR	100.09%	751	501 191
ISPIM Float 06/20	800 000	99.78%	EUR	99.78%	259	798 491
GE Float 01/2020	1 000 000	100.21%	EUR	100.21%	100	1 002 240
GIS Float 01/2020	400 000	100.85%	EUR	100.85%	339	403 731
MCD Float 08/2019	300 000	100.23%	EUR	100.23%		300 699
						44 126 231
Acções						
SIEMENS	686	113.22	EUR	113.22		77 669
ALLIANZ	102	177.02	EUR	177.02		18 056
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.15	EUR	9.15		14 225
BASF	587	81.91	EUR	81.91		48 081
BAYER AG	579	94.35	EUR	94.35		54 629
ADIDAS- SALOMON AG	168	186.95	EUR	186.95		31 408
SAP SE	392	98.95	EUR	98.95		38 788
LUFTHANSA	1 104	20.60	EUR	20.60		22 742

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DEUTSCHE TELEKOM	1 833	13.27	EUR	13.27		24 324
DAIMLER CHRYSLER	377	55.13	EUR	55.13		20 784
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	21.83	EUR	21.83		43 114
DEUTSCHE POST	409	27.97	EUR	27.97		11 440
PUMA AG	11	501.00	EUR	501.00		5 511
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	142.22	EUR	142.22		69 688
LEONI AG	987	43.50	EUR	43.50		42 935
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	68.80	EUR	68.80		48 298
COVESTRO AG	187	76.42	EUR	76.42		14 291
VONOVIA SE	1	40.76	EUR	40.76		41
DANONE	747	62.87	EUR	62.87		46 964
PERNOD RICARD	90	139.90	EUR	139.90		12 591
TOTAL SA	2 134	52.21	EUR	52.21		111 416
Kering	137	483.60	EUR	483.60		66 253
PEUGEOT CITROEN	2 447	19.56	EUR	19.56		47 863
BNP	204	53.19	EUR	53.19		10 851
AIR LIQUIDE	250	107.70	EUR	107.70		26 925
SCHNEIDER	383	71.42	EUR	71.42		27 354
L.V.M.H.	235	285.20	EUR	285.20		67 022
ACCOR	321	42.02	EUR	42.02		13 488
ORANGE	3 300	14.35	EUR	14.35		47 339
GLE ENTREP. VINCI	335	82.36	EUR	82.36		27 591
SANOFI SYNHLABO	311	68.65	EUR	68.65		21 350
AIRBUS SE	601	100.26	EUR	100.26		60 256
ARKEMA	117	101.40	EUR	101.40		11 864
3I GROUP	2 384	9.01	GBP	10.18		24 263
RECKITT BENCKISER	219	62.39	GBP	70.51		15 441
WEIR GROUP PLC	971	20.00	GBP	22.60		21 946
OCADO GROUP PLC	2 109	10.28	GBP	11.61		24 489
ADMIRAL GROUP PLC	2 085	19.08	GBP	21.56		44 944
ASHTED GROUP PLC	842	22.73	GBP	25.69		21 628
SHIRE PLC	753	42.65	GBP	48.20		36 293
AMADEUS HOLDING SA	565	67.60	EUR	67.60		38 194
ROYAL DUTCH SHELL B	615	27.14	GBP	30.66		18 859
ROTORK PLC	5 663	3.35	GBP	3.78		21 419
TELEFONICA	5 042	7.28	EUR	7.28		36 701
BCO SANTANDER C.HISP	20 080	4.59	EUR	4.59		92 207
IBERDROLA	3 831	6.62	EUR	6.62		25 377
MASMOVIL IBERCOM	169	99.60	EUR	99.60		16 832
UNICREDITO ITALIANO	2 396	14.30	EUR	14.30		34 253
BANCA INTESA	11 322	2.49	EUR	2.49		28 152
ENEL	4 661	4.76	EUR	4.76		22 172
ESSITY AKTIEBO-B	619	221.20	SEK	21.16		13 097
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	20.51	EUR	20.51		11 032
ING GROEP NV	5 284	12.33	EUR	12.33		65 141
UNILEVER NV-CVA	1 685	47.79	EUR	47.79		80 518
ASML NA	432	169.70	EUR	169.70		73 310

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AKZO NOBEL NV NLG20	227	73.32	EUR	73.32		16 644
ABN AMRO GROUP NV	2 296	22.22	EUR	22.22		51 017
ASR NEDERLAND NV	1 275	34.98	EUR	34.98		44 600
EURONEXT NV	441	54.45	EUR	54.45		24 012
VESTAS WIND SYSTEMS	220	395.00	DKK	53.01		11 663
ANHEUSER-BUSCH INB	960	86.50	EUR	86.50		83 040
BPOST SA	1 601	13.53	EUR	13.53		21 662
OMV AG	247	48.57	EUR	48.57		11 997
ERST BK DER OEST.SPA	949	35.75	EUR	35.75		33 927
RAIFFEISEN INTL BK H	1 681	26.29	EUR	26.29		44 193
TENARIS SA	1 683	15.72	EUR	15.72		26 448
ARCELOR MITTAL	909	25.11	EUR	25.11		22 825
						2 343 446
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					108	1 797 315
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.16%	EUR	100.16%		300 489
F Float 12/21	500 000	99.20%	EUR	99.20%	20	496 000
UBS Float 09/22	700 000	100.08%	EUR	100.08%	81	700 606
AGN Float 06/19	300 000	100.07%	EUR	100.07%	7	300 220
						1 797 315
						66 858 104

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						14 351 902
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.45	EUR	4.45		9 786 526
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.82	EUR	3.82		2 860 227
CXG PRIVATE EQUITY	40 509	5.62	EUR	5.62		227 754
CXG INFRAESTRUTURAS	119 942	6.77	EUR	6.77		812 007
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.33	EUR	5.33		665 389
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						22 588 937
MS EUROCORP DURHED Z	180 722	29.09	EUR	29.09		5 257 203
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	32.02	EUR	32.02		1 802 790
Amundi Funds II-Eur	195 755	9.38	EUR	9.38		1 836 182
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.73	EUR	16.73		148 261
Schroder ISF Euro Eq	41 285	44.30	EUR	44.30		1 828 781
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	144.32	EUR	144.32		343 482
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.23	EUR	7.23		340 005
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.67	EUR	1.67		224 675
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 362.13	EUR	1 362.13		265 615
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	104.35	EUR	104.35		227 698
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	128.39	EUR	128.39		182 703
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 834.65	EUR	1 834.65		1 919 044
Janus Hend Horiz Eur	124 650	14.35	EUR	14.35		1 788 728
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 024.26	EUR	1 024.26		587 925
DNCA INVEST-MIURA-I	917	125.89	EUR	125.89		115 441
HYPO DJ ESTX 50 FRA	75 052	34.49	EUR	34.49		2 588 168

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ISHARES S&P 500 MONT	50 815	61.64	EUR	61.64		3 132 237
OIC domici. em Estados não membros da EU						25 065
TISHMAN ESOF	91 579	0.27	EUR	0.27		25 065
						36 965 904

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			268
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			219
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			717 928
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			47 067
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			103
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			353
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			1 083 267
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			165 250
						2 014 475
						2 014 475

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos

Valores Passivos

1 117 797
-2 534 531
-1 416 733
111 928 151

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

TYU8 USD CBT 09/18	-16	120.22	USD	102.94		-1 646 973
--------------------	-----	--------	-----	--------	--	------------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 330 161.96

Valor da Unidade de Participação: € 13.4365