

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2017-09-30

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.					7 228	454 934
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	80 000	120.71%	EUR	120.71%	3 700	100 268
OT 4.125% 04/2027	62 000	114.63%	EUR	114.63%	1 794	72 862
						173 129
Obrigações diversas						
SANTAN 1.625% 06/19	100 000	102.87%	EUR	102.87%	499	103 368
CXGD 1% 01/2022	100 000	101.39%	EUR	101.39%	677	102 065
RENEPL Float 20	60 000	104.85%	EUR	104.85%	560	63 470
						268 902
Acções						
EDP Renováveis	1 792	7.20	EUR	7.20		12 902
Outros Merc. Regulamentados Nacionais					3	78 035
Títulos de Dívida Pública						
BT 17NOV2017	78 000	100.04%	EUR	100.04%	3	78 035
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					65 215	11 242 081
Títulos de Dívida Pública						
DBR 4.75% 98/2028	209 000	144.40%	EUR	144.40%	2 421	304 215
DBR 5.5% 01/04/31	56 000	161.09%	EUR	161.09%	2 278	92 488
DBR 4% 04/01/37	13 000	153.13%	EUR	153.13%	385	20 291
DBR 4% 01/2018	830 000	101.21%	EUR	101.21%	24 559	864 619
DBR 2.5% 07/2044	153 000	129.23%	EUR	129.23%	933	198 648
DBR 1.5% 02/2023	33 000	109.32%	EUR	109.32%	309	36 386
DBR 0.5% 08/27	148 000	100.35%	EUR	100.35%	160	148 677
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	157.57%	EUR	157.57%	2 548	207 389
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	133.08%	EUR	133.08%	345	40 270
FRTR 1.75% 11/2024	186 000	110.48%	EUR	110.48%	2 765	208 255
FRTR 0.25% 11/26	70 000	96.32%	EUR	96.32%	149	67 571
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	108.95%	EUR	108.95%	1 509	208 504
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	136.84%	EUR	136.84%	406	68 825
SPGB 4.4% 10/2023	437 000	122.29%	EUR	122.29%	17 648	552 059
SPGB 1.95%04/26	63 000	105.24%	EUR	105.24%	518	66 820
SPGB 3.45% 07/66	51 000	106.26%	EUR	106.26%	304	54 495
SPGB0.4% 04/22	149 000	100.63%	EUR	100.63%	251	150 183
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	120.58%	EUR	120.58%	630	97 093
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	108.42%	EUR	108.42%	18	5 439
BTPS 5.5% 09/2022	176 000	122.46%	EUR	122.46%	802	216 325
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	118.55%	EUR	118.55%	2 021	130 052
BTPS 4.5% 03/2024	88 000	119.23%	EUR	119.23%	328	105 254
BTPS 3.5% 03/2030	15 000	111.35%	EUR	111.35%	44	16 747
TB 0.826% 02/2018	90 000	99.64%	USD	99.64%	413	76 329
						3 936 934

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Obrigações diversas						
BCPPL 0.75% 05/22	100 000	100.54%	EUR	100.54%	253	100 792
DAIGR Float 07/24	100 000	100.07%	EUR	100.07%	30	100 099
ACAFP Float 04/22	100 000	102.06%	EUR	102.06%	95	102 154
MCFP Float 11/18	60 000	100.31%	EUR	100.31%		60 187
BNP Float 06/24	100 000	101.29%	EUR	101.29%	28	101 320
RENAUL Float 03/2022	100 000	100.91%	EUR	100.91%	16	100 926
HSBC Float 09/22	100 000	101.43%	EUR	101.43%	4	101 434
LLOYDS Float 06/2024	100 000	101.03%	EUR	101.03%	13	101 040
CABKSM 1.25% 01/27	100 000	102.11%	EUR	102.11%	901	103 012
SANTAN Float 03/22	100 000	101.63%	EUR	101.63%	19	101 648
SCANIA Float 04/20	100 000	100.34%	EUR	100.34%	14	100 357
BAC Float 05/23	100 000	101.05%	EUR	101.05%	72	101 123
MS Float 11/22	100 000	101.04%	EUR	101.04%	56	101 093
T Float 09/2023	100 000	101.89%	EUR	101.89%	38	101 932
NDASS Float 09/21	100 000	101.49%	EUR	101.49%	2	101 492
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.45%	EUR	100.45%	60	100 510
LANSNA 0.875% 02/27	100 000	99.25%	EUR	99.25%	547	99 792
VW Float 03/19	100 000	100.09%	EUR	100.09%	0	100 092
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.16%	EUR	100.16%	10	100 175
KBCBB Float 11/22	100 000	100.76%	EUR	100.76%	23	100 779
DLTAS 2008-1 A	83 899	99.40%	EUR	99.40%	4	83 401
CGD S.758 12/2017	650 000	99.67%	EUR	99.67%	294	648 180
NDB 0.25% 08/21	100 000	100.38%	EUR	100.38%	27	100 406
SUMIBK Float 06/22	100 000	100.55%	EUR	100.55%	6	100 558
CAFP Float 03/2020	100 000	100.58%	EUR	100.58%	6	100 588
SANTAN Float 03/2020	100 000	101.00%	EUR	101.00%	20	101 015
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.71%	EUR	100.71%	14	100 728
UPS Float 07/2020	100 000	100.61%	EUR	100.61%	21	100 631
DE Float 04/20	100 000	100.45%	EUR	100.45%	4	100 453
GS Float 07/2022	75 000	102.43%	EUR	102.43%	94	76 916
GS Float 29/05/2020	75 000	101.04%	EUR	101.04%	26	75 806
BAC Float 05/2019	100 000	101.73%	EUR	101.73%	176	101 902
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.48%	EUR	100.48%		65 312
MMM Float 05/20	100 000	100.44%	EUR	100.44%		100 437
ANNGR Float 09/18	100 000	100.13%	EUR	100.13%	2	100 127
UNANA Float 06/18	100 000	100.15%	EUR	100.15%		100 153
ARRFP Float 01/2020	100 000	101.15%	EUR	101.15%	92	101 243
POHBK Float 03/20	100 000	100.58%	EUR	100.58%		100 581
SKYLN Float 04/20	100 000	101.10%	EUR	101.10%	105	101 209
VOD Float 02/2019	100 000	101.21%	EUR	101.21%	64	101 272
CAT Float 05/2018	100 000	100.10%	EUR	100.10%		100 097
UCGIM Float 12/2017	50 000	100.36%	EUR	100.36%	28	50 208
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.67%	EUR	100.67%		151 011
MAERSK Float 03/19	100 000	102.00%	EUR	102.00%	46	102 049
F Float 02/2018	100 000	100.09%	EUR	100.09%	21	100 109
ISPIM Float 04/2019	100 000	101.33%	EUR	101.33%	152	101 481

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GE Float 01/2020	100 000	100.58%	EUR	100.58%	10	100 585
GIS Float 01/2020	100 000	101.26%	EUR	101.26%	84	101 343
BMW Float 03/2019	100 000	100.34%	EUR	100.34%	2	100 344
MCD Float 08/2019	100 000	100.33%	EUR	100.33%		100 325
						5 448 425
Acções						
BMW	116	85.83	EUR	85.83		9 956
SIEMENS	572	119.20	EUR	119.20		68 182
ALLIANZ	432	189.95	EUR	189.95		82 058
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 179	9.58	EUR	9.58		11 290
BASF	356	90.04	EUR	90.04		32 054
BAYER AG	403	115.30	EUR	115.30		46 466
SAP SE	297	92.69	EUR	92.69		27 529
LUFTHANSA	997	23.51	EUR	23.51		23 439
DEUTSCHE TELEKOM	2 750	15.79	EUR	15.79		43 409
DAIMLER CHRYSLER	425	67.47	EUR	67.47		28 675
THYSSEN KRUPP	421	25.08	EUR	25.08		10 557
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	21.27	EUR	21.27		31 480
VOLKSWAGEN AG-PREF.	113	138.00	EUR	138.00		15 594
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	68.25	EUR	68.25		36 514
DEUTSCHE WOHNEN	319	35.92	EUR	35.92		11 458
ZALANDO SE	361	42.40	EUR	42.40		15 306
FRAPORT AG	234	80.34	EUR	80.34		18 800
DANONE	654	66.37	EUR	66.37		43 406
TOTAL SA	1 419	45.45	EUR	45.45		64 486
Kering	87	337.05	EUR	337.05		29 323
BNP	541	68.25	EUR	68.25		36 923
AIR LIQUIDE	101	112.85	EUR	112.85		11 398
SCHNEIDER	627	73.63	EUR	73.63		46 166
L.V.M.H.	251	233.45	EUR	233.45		58 596
RENAULT SA	186	83.11	EUR	83.11		15 458
SOCIETE GENERALE	1 159	49.54	EUR	49.54		57 411
VALEO SA	502	62.78	EUR	62.78		31 516
PUBLICIS	233	59.09	EUR	59.09		13 768
GLE ENTREP. VINCI	555	80.40	EUR	80.40		44 622
SANOFI SYNHLABO	243	84.01	EUR	84.01		20 414
ARKEMA	136	103.75	EUR	103.75		14 110
ILIAD SA	66	224.85	EUR	224.85		14 840
AMUNDI SA	439	70.32	EUR	70.32		30 870
DIAGEO ORD.	344	24.53	GBP	27.83		9 572
3I GROUP	2 693	9.13	GBP	10.36		27 890
Imperial Brands PLC	298	31.84	GBP	36.12		10 763
RECKITT BENCKISER	168	68.13	GBP	77.28		12 983
OCADO GROUP PLC	2 608	2.93	GBP	3.32		8 659
SHIRE PLC	571	37.88	GBP	42.97		24 535
AMADEUS HOLDING SA	495	54.99	EUR	54.99		27 220
ROYAL DUTCH SHELL B	305	22.95	GBP	26.03		7 938

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BCO SANTANDER C.HISP	14 851	5.91	EUR	5.91		87 725
IBERDROLA	2 906	6.57	EUR	6.57		19 098
REPSOL	901	15.59	EUR	15.59		14 047
INDITEX	1 078	31.89	EUR	31.89		34 372
TELECOM ITALIA	12 820	0.79	EUR	0.79		10 160
BANCA INTESA	6 915	2.99	EUR	2.99		20 690
ENEL	4 172	5.10	EUR	5.10		21 256
Leonardo SpA	1 266	15.85	EUR	15.85		20 066
AZIMUT HOLDING SPA	1 621	18.30	EUR	18.30		29 664
FINECOBANK SPA	1 877	7.50	EUR	7.50		14 078
ESSITY AKTIEBO-B	469	221.60	SEK	22.99		10 784
ALFA LAVAL AB	1 000	198.90	SEK	20.64		20 638
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	15.82	EUR	15.82		6 455
ING GROEP NV	4 355	15.60	EUR	15.60		67 938
UNILEVER NV-CVA	1 215	50.04	EUR	50.04		60 799
ASML NA	395	144.05	EUR	144.05		56 900
AKZO NOBEL NV NLG20	173	78.12	EUR	78.12		13 515
ALTICE NV A-W/I	972	16.95	EUR	16.95		16 471
VESTAS WIND SYSTEMS	258	565.00	DKK	75.92		19 588
FLSMIDTH & CO A/S	334	416.30	DKK	55.94		18 684
PANDORA A/S	243	621.50	DKK	83.52		20 294
ANHEUSER-BUSCH INB	676	101.30	EUR	101.30		68 479
CRH ORD	365	32.20	EUR	32.20		11 751
ARCELOR MITTAL	808	21.83	EUR	21.83		17 635
						1 856 722
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					2	112 370
Obrigações diversas						
AGN Float 06/19	100 000	100.09%	EUR	100.09%	2	100 096
Acções						
SUNRISE COM. GROUP	176	79.80	CHF	69.74		12 274
						11 887 420

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						2 727 743
CXG OBRIGAÇÕES	167 157	4.48	EUR	4.48		748 847
CXG IMOBILIARIO	198 914	3.65	EUR	3.65		726 414
CXG PRIVATE EQUITY	21 147	5.98	EUR	5.98		126 535
CXG INFRAESTRUTURAS	33 755	6.63	EUR	6.63		223 725
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.34	EUR	5.34		601 279
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	1 037.52	EUR	1 037.52		60 176
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	9.79	EUR	9.79		70 557
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	3.01	EUR	3.01		50 570
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						8 567 848
SGAM FD ABSOL RETRN	17	1 080.26	EUR	1 080.26		18 364

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BROCK EURO MKT Fd D2	36 251	33.00	EUR	33.00		1 196 283
PIONEER EUROLND EQ I	124 897	9.47	EUR	9.47		1 182 775
BANTLEON OPPORTUNIT	1 746	175.15	EUR	175.15		305 812
BNY MELLON ABS RET	20 006	1.18	EUR	1.18		23 601
AXA WF EU CREDIT	2 650	136.54	EUR	136.54		361 831
Natixis Tresorie I	28	12 546.07	EUR	12 546.07		351 290
HENDERSON HPE.ALPHA	1 764	16.75	EUR	16.75		29 547
Schroder ISF Euro Eq	26 568	45.00	EUR	45.00		1 195 470
Theadneedle Credit O	31 550	1.35	EUR	1.35		42 693
MERRILL LYNCH MARSH	469	143.48	EUR	143.48		67 292
PIONEER FUN RT CURRE	22	1 219.65	EUR	1 219.65		26 832
HENDERSON GART UK	9 278	7.20	EUR	7.20		66 757
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.66	EUR	1.66		44 206
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 293.02	EUR	1 293.02		49 135
SCH EUROP ALPHA ABS	431	109.31	EUR	109.31		47 111
LYXOR EPSILON GLOB E	281	117.74	EUR	117.74		33 084
ALLIANZ RCM EUR EQTY	687	1 781.32	EUR	1 781.32		1 223 767
MUZINICH LNG/SHT CRD	272	103.29	EUR	103.29		28 095
HENDERSON HORIZ.Euro	78 188	14.95	EUR	14.95		1 168 911
BNP PARIBAS MOIS IC	15	23 113.72	EUR	23 113.72		346 706
HYPO DJ ESTX 50 FRA	4 999	35.83	EUR	35.83		179 089
ISHARES S&P 500 MONT	10 140	57.12	EUR	57.12		579 197
						11 295 591

LIQUIDEZ

À vista						1 766 464
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			469
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			305
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 756 006
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 571
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			59
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			57
DO CGD - USD 0.0000%			USD			833
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			7 164
						1 766 464
						1 766 464

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						5 293
Valores Passivos						-74 598
						-69 304
						24 880 169

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYZ7-USD CBT 12/17	-4	125.41	USD	106.16		-424 638

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 3 967 105.36

Valor da Unidade de Participação: € 6.2716