

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
 Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
<b>COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA</b>						
<b>VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS</b>						
Merc. Cot. Oficiais de Bolsa Val. Port.					2 624	326 987
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	313 000	97.18%	EUR	97.18%	2 624	306 804
Acções						
EDP Renováveis	2 362	8.55	EUR	8.55		20 183
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					184 934	63 727 602
Títulos de Dívida Pública						
DBR 5.5% 01/04/31	760 000	160.81%	EUR	160.81%	27 485	1 249 626
DBR 4% 04/01/37	630 000	156.41%	EUR	156.41%	16 570	1 001 959
DBR 3.25% 01/2020	1 900 000	105.28%	EUR	105.28%	40 603	2 040 961
DBR 3% 07/2020	998 000	106.69%	EUR	106.69%	4 840	1 069 636
DBR 2.5% 07/2044	600 000	136.03%	EUR	136.03%	2 425	818 593
DBR 1.5% 02/2023	1 100 000	108.29%	EUR	108.29%	8 951	1 200 108
DBR 1.5% 05/2023	481 000	108.59%	EUR	108.59%	2 155	524 487
DBR 1.75% 2/2024	455 000	110.76%	EUR	110.76%	4 319	508 264
BKO 0% 09/18	1 320 000	99.95%	EUR	99.95%		1 319 287
BKO 0% 12/18	574 000	100.08%	EUR	100.08%		574 465
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	161.73%	EUR	161.73%	5 312	545 473
FRTR 3% 04/2022	960 000	112.11%	EUR	112.11%	10 179	1 086 415
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	139.01%	EUR	139.01%	2 600	412 671
SPGB 4.6% 07/2019	1 013 000	104.58%	EUR	104.58%	4 213	1 063 578
SPGB 5.15% 10/2044	250 000	151.67%	EUR	151.67%	10 759	389 934
SPGB 3.45% 07/66	271 000	114.06%	EUR	114.06%	845	309 948
SPGB0.4% 04/22	290 000	101.01%	EUR	101.01%	394	293 323
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	100.84%	EUR	100.84%	4 599	1 237 896
BTPS 4% 2/2037	700 000	105.47%	EUR	105.47%	2 359	740 656
BTPS 5% 03/2025	514 000	111.84%	EUR	111.84%	12 850	587 728
BTPS 4.5% 03/2024	220 000	108.12%	EUR	108.12%	4 950	242 803
						17 217 810
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	102.39%	EUR	102.39%	45	409 605
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	99.38%	EUR	99.38%	237	1 093 395
VW Float 07/19	200 000	100.07%	EUR	100.07%	9	200 147
VW Float 07/21	200 000	99.69%	EUR	99.69%	41	199 413
BASGR Float 11/19	200 000	100.29%	EUR	100.29%		200 570
SAPGR Float 03/21	300 000	100.43%	EUR	100.43%		301 302
VW Float 10/19	200 000	100.07%	EUR	100.07%	8	200 142
VW Float 12/21	200 000	100.36%	EUR	100.36%	179	200 905
ACAFP Float 04/22	900 000	100.50%	EUR	100.50%	515	905 033
MCFP Float 11/18	200 000	100.07%	EUR	100.07%		200 132
BNP Float 06/24	600 000	99.96%	EUR	99.96%	613	600 343
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.12%	EUR	100.12%	306	400 794

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
 Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RENAULT Float 11/24	800 000	98.62%	EUR	98.62%	156	789 076
ALDFP Float 11/20	300 000	100.02%	EUR	100.02%	5	300 062
BNP Float 05/23	500 000	99.54%	EUR	99.54%	42	497 742
HSBC Float 09/22	350 000	100.52%	EUR	100.52%	241	352 047
SANUK Float 05/23	200 000	99.50%	EUR	99.50%	31	199 027
RBS Float 06/20	500 000	100.04%	EUR	100.04%	129	500 324
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	99.74%	EUR	99.74%	914	998 294
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	99.70%	EUR	99.70%	288	997 308
RBS Float 03/2020	200 000	100.00%	EUR	100.00%	39	200 039
IBESM Float 02/24	700 000	100.90%	EUR	100.90%	82	706 413
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.08%	EUR	101.08%	1 394	1 012 194
BBVASM Float 04/22	700 000	100.06%	EUR	100.06%	277	700 669
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	101.88%	EUR	101.88%	2 822	410 322
SCANIA Float 10/18	100 000	100.04%	EUR	100.04%	3	100 042
SCANIA Float 04/20	300 000	100.19%	EUR	100.19%	28	300 592
SRGIM Float 08/24	1 000 000	98.30%	EUR	98.30%	68	983 018
FCABNK Float 06/21	100 000	98.83%	EUR	98.83%		98 825
MS Float 01/22	300 000	100.39%	EUR	100.39%	114	301 272
BAC Float 02/22	200 000	100.79%	EUR	100.79%	67	201 649
BAC Float 05/23	450 000	100.58%	EUR	100.58%	150	452 764
GM Float 05/21	800 000	100.46%	EUR	100.46%	176	803 848
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.12%	EUR	100.12%		1 001 170
BATSLN Float 08/21	500 000	100.03%	EUR	100.03%	40	500 165
GS Float 09/23	300 000	99.19%	EUR	99.19%	166	297 748
T Float 09/2023	1 000 000	101.00%	EUR	101.00%	1 308	1 011 268
C Float 03/23	500 000	99.89%	EUR	99.89%	177	499 627
GM Float 03/22	300 000	99.70%	EUR	99.70%	127	299 227
BAC FLOAT 04/24	400 000	99.88%	EUR	99.88%	160	399 668
NDASS Float 09/21	400 000	100.86%	EUR	100.86%	129	403 569
UBS Float 04/2021	500 000	100.55%	EUR	100.55%	99	502 859
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.13%	EUR	100.13%	122	801 194
VW Float 03/19	200 000	100.08%	EUR	100.08%	9	200 165
DAIGR Float 05/22	100 000	99.66%	EUR	99.66%		99 657
MYL Float 05/20	200 000	100.12%	EUR	100.12%	8	200 242
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.19%	EUR	100.19%	6	601 146
AEGON 0.375% 11/24	100 000	99.55%	EUR	99.55%	292	99 845
ALVGR Float 12/20	500 000	100.91%	EUR	100.91%	213	504 758
DAIGR Float 04/20	200 000	100.43%	EUR	100.43%	54	200 922
TOYOTA FLT 04/27	500 000	99.93%	EUR	99.93%	15	499 665
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.32%	EUR	100.32%	127	301 072
NYKRE Float 06/22	700 000	99.89%	EUR	99.89%	431	699 675
JYBC Float 06/20	400 000	100.30%	EUR	100.30%	29	401 237
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.29%	EUR	100.29%	169	401 309
KBCBB Float 11/22	400 000	99.83%	EUR	99.83%	21	399 353
DLTAS 2008-1 A	636 536	99.50%	EUR	99.50%	32	633 367
DE Float 09/20	100 000	100.19%	EUR	100.19%		100 185
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.77%	EUR	99.77%	142	498 992

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
 Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
MIZUHO Float 04/23	500 000	100.10%	EUR	100.10%	132	500 617
NAB Float 04/2021	300 000	101.06%	EUR	101.06%	91	303 277
BMO Float 09/21	200 000	100.64%	EUR	100.64%	64	201 346
BMO Float 03/22	200 000	100.52%	EUR	100.52%	79	201 127
BCHINA Float 11/20	400 000	99.88%	EUR	99.88%	17	399 537
BNFP Float 01/2020	700 000	100.28%	EUR	100.28%	8	701 961
CAFP Float 03/2020	800 000	100.34%	EUR	100.34%	304	803 048
BFCM Float 03/2019	700 000	100.36%	EUR	100.36%	564	703 105
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.45%	EUR	100.45%	61	703 176
UPS Float 07/2020	200 000	100.62%	EUR	100.62%	28	201 272
DE Float 04/20	300 000	100.32%	EUR	100.32%	10	300 970
JPM Float 01/2020	300 000	100.61%	EUR	100.61%	69	301 893
ABBKEY Float 05/2019	600 000	100.36%	EUR	100.36%	51	602 205
MS Float 11/19	250 000	100.64%	EUR	100.64%	32	251 642
GS Float 07/2022	600 000	101.64%	EUR	101.64%	419	610 265
GS Float 29/05/2020	750 000	100.77%	EUR	100.77%	24	755 829
BAC Float 05/2019	600 000	100.68%	EUR	100.68%	494	604 562
C Float 11/2019	700 000	100.47%	EUR	100.47%	85	703 361
CS Float 10/2019	700 000	100.43%	EUR	100.43%	118	703 121
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.38%	EUR	100.38%		200 762
MMM Float 05/20	800 000	100.43%	EUR	100.43%		803 424
ANNGR Float 09/18	200 000	100.01%	EUR	100.01%	26	200 038
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.33%	EUR	100.33%	606	803 262
POHBK Float 03/20	500 000	100.31%	EUR	100.31%		501 550
RY Float 03/2019	300 000	100.22%	EUR	100.22%	69	300 735
SKYLN Float 04/20	300 000	100.75%	EUR	100.75%	217	302 464
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.32%	EUR	100.32%		501 580
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.41%	EUR	100.41%		301 218
FDX Float 04/19	300 000	100.25%	EUR	100.25%	99	300 849
ISPIM Float 04/2019	500 000	100.14%	EUR	100.14%	466	501 166
ISPIM Float 06/20	800 000	99.97%	EUR	99.97%	1 264	801 016
GE Float 01/2020	1 000 000	100.26%	EUR	100.26%	66	1 002 666
GIS Float 01/2020	400 000	100.80%	EUR	100.80%	214	403 410
MCD Float 08/2019	300 000	100.20%	EUR	100.20%		300 609
						43 742 848
Acções						
SIEMENS	895	111.98	EUR	111.98		100 222
ALLIANZ	102	183.64	EUR	183.64		18 731
E.ON AG(EX VEBAG)	1 554	9.18	EUR	9.18		14 266
BASF	587	79.69	EUR	79.69		46 778
BAYER AG	579	80.38	EUR	80.38		46 540
ADIDAS- SALOMON AG	222	214.90	EUR	214.90		47 708
SAP SE	392	103.62	EUR	103.62		40 619
DEUTSCHE TELEKOM	1 833	13.91	EUR	13.91		25 497
DAIMLER CHRYSLER	377	55.70	EUR	55.70		20 999
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	21.92	EUR	21.92		43 292

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	140.84	EUR	140.84		69 012
LEONI AG	987	37.13	EUR	37.13		36 647
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	65.78	EUR	65.78		46 178
COVESTRO AG	187	73.38	EUR	73.38		13 722
VONOVIA SE	1	44.19	EUR	44.19		44
DANONE	747	67.82	EUR	67.82		50 662
PERNOD RICARD	90	136.00	EUR	136.00		12 240
TOTAL SA	2 134	53.87	EUR	53.87		114 959
Kering	107	468.00	EUR	468.00		50 076
PEUGEOT CITROEN	2 447	23.70	EUR	23.70		57 994
BNP	204	50.58	EUR	50.58		10 318
AIR LIQUIDE	250	108.50	EUR	108.50		27 125
SCHNEIDER	213	70.24	EUR	70.24		14 961
L.V.M.H.	298	301.85	EUR	301.85		89 951
ORANGE	3 300	13.95	EUR	13.95		46 035
GLE ENTREP. VINCI	245	82.56	EUR	82.56		20 227
SANOFI SYNHLABO	311	73.69	EUR	73.69		22 918
AIRBUS SE	623	106.26	EUR	106.26		66 200
ARKEMA	117	107.90	EUR	107.90		12 624
SAFRAN SA	505	112.30	EUR	112.30		56 712
3I GROUP	2 384	8.96	GBP	10.02		23 889
RECKITT BENCKISER	219	65.59	GBP	73.32		16 057
WEIR GROUP PLC	971	18.75	GBP	20.95		20 347
OCADO GROUP PLC	2 109	10.73	GBP	11.99		25 285
ADMIRAL GROUP PLC	2 085	20.80	GBP	23.25		48 480
ASHTED GROUP PLC	842	23.62	GBP	26.40		22 232
SHIRE PLC	753	44.99	GBP	50.29		37 866
AMADEUS HOLDING SA	565	79.92	EUR	79.92		45 155
ROYAL DUTCH SHELL B	615	25.41	GBP	28.40		17 466
ROTORK PLC	5 663	3.38	GBP	3.78		21 397
TELEFONICA	5 042	6.99	EUR	6.99		35 228
BCO SANTANDER C.HISP	20 080	4.29	EUR	4.29		86 103
IBERDROLA	3 831	6.42	EUR	6.42		24 603
MASMOVIL IBERCOM	169	97.30	EUR	97.30		16 444
UNICREDITO ITALIANO	2 396	12.43	EUR	12.43		29 792
ENI SPA	722	15.98	EUR	15.98		11 538
BANCA INTESA	11 322	2.13	EUR	2.13		24 088
ENEL	4 661	4.26	EUR	4.26		19 856
ESSITY AKTIEBO-B	619	237.00	SEK	22.31		13 811
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	20.96	EUR	20.96		11 276
ING GROEP NV	5 284	11.69	EUR	11.69		61 770
UNILEVER NV-CVA	1 685	49.55	EUR	49.55		83 483
ASML NA	432	175.64	EUR	175.64		75 876
AKZO NOBEL NV NLG20	227	80.52	EUR	80.52		18 278
ABN AMRO GROUP NV	2 296	23.33	EUR	23.33		53 566
ASR NEDERLAND NV	1 275	41.10	EUR	41.10		52 403
EURONEXT NV	441	56.60	EUR	56.60		24 961

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
VESTAS WIND SYSTEMS	230	447.50	DKK	60.02		13 805
ANHEUSER-BUSCH INB	960	80.65	EUR	80.65		77 424
ERST BK DER OEST.SPA	949	34.27	EUR	34.27		32 522
RAIFFEISEN INTL BK H	1 681	24.50	EUR	24.50		41 185
TENARIS SA	1 683	14.45	EUR	14.45		24 319
ARCELOR MITTAL	909	25.94	EUR	25.94		23 579
						2 357 339
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					620	1 795 763
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.14%	EUR	100.14%		300 405
F Float 12/21	500 000	98.26%	EUR	98.26%	63	491 373
UBS Float 09/22	700 000	100.46%	EUR	100.46%	535	703 741
AGN Float 06/19	300 000	100.07%	EUR	100.07%	22	300 244
						1 795 763
						65 850 352

### UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						14 264 445
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.45	EUR	4.45		9 796 208
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.85	EUR	3.85		2 889 157
CXG PRIVATE EQUITY	40 509	5.77	EUR	5.77		233 644
CXG INFRAESTRUTURAS	94 830	7.17	EUR	7.17		679 722
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.33	EUR	5.33		665 713
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						21 456 633
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	32.62	EUR	32.62		1 836 571
Amundi Funds II-Eur	195 755	9.48	EUR	9.48		1 855 757
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.70	EUR	16.70		147 995
Schroder ISF Euro Eq	41 285	45.56	EUR	45.56		1 880 891
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	146.11	EUR	146.11		347 742
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.21	EUR	7.21		339 195
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.65	EUR	1.65		222 114
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 341.78	EUR	1 341.78		261 647
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	104.90	EUR	104.90		228 885
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	126.73	EUR	126.73		180 342
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 881.64	EUR	1 881.64		1 968 195
Janus Hend Horiz Eur	124 650	14.55	EUR	14.55		1 813 658
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 018.71	EUR	1 018.71		584 740
DNCA INVEST-MIURA-I	917	123.82	EUR	123.82		113 543
MS EUROCORP BD-Z	129 701	29.18	EUR	29.18		3 784 675
HYPO DJ ESTX 50 FRA	75 052	34.45	EUR	34.45		2 585 166
ISHARES S&P 500 MONT	50 815	65.05	EUR	65.05		3 305 516
OIC domici. em Estados não membros da EU						25 525
TISHMAN ESOF	91 579	0.28	EUR	0.28		25 525
						35 746 603

### OUTROS ACTIVOS

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
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						2 151 340
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			276
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			219
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 982 869
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			831
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			101
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			27
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			188
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			166 809
						2 151 340
						2 151 340

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						17 625
Valores Passivos						-238 567
						-220 942
						111 033 752

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO  
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYU8 USD CBT 09/18	-16	120.45	USD	103.87		-1 661 996

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 242 283.71

Valor da Unidade de Participação: € 13.4712