

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-03-31

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.					7 439	471 743
Titulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	330 000	123.87%	EUR	123.87%	7 071	415 826
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	103.21%	EUR	103.21%	368	41 654
Acções						
EDP Renováveis	1 792	7.96	EUR	7.96		14 264
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						78 090
Titulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	78 000	100.12%	EUR	100.12%		78 090
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					38 227	11 277 236
Titulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	230 000	136.10%	EUR	136.10%	3 426	316 456
DBR 5.5% 01/04/31	670 000	159.31%	EUR	159.31%	8 783	1 076 174
DBR 2.5% 07/2044	197 000	131.84%	EUR	131.84%	3 657	263 372
DBR 1.5% 02/2023	45 000	108.14%	EUR	108.14%	83	48 745
DBR 1.75% 2/2024	130 000	110.22%	EUR	110.22%	280	143 563
BKO 0% 09/18	660 000	100.25%	EUR	100.25%		661 617
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	162.90%	EUR	162.90%	5 465	217 231
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	139.57%	EUR	139.57%	831	42 701
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	125.51%	EUR	125.51%	828	132 614
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	106.58%	EUR	106.58%	5 867	208 374
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	150.50%	EUR	150.50%	1 577	76 829
SPGB 3.45% 07/66	51 000	126.35%	EUR	126.35%	1 181	65 619
SPGB 0.45% 10/22	286 000	101.68%	EUR	101.68%	536	291 346
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	121.04%	EUR	121.04%	619	97 449
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	106.51%	EUR	106.51%	18	5 343
BTPS 5.5% 09/2022	176 000	121.95%	EUR	121.95%	815	215 449
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	119.09%	EUR	119.09%	2 027	130 641
BTPS 4.5% 03/2024	90 000	120.42%	EUR	120.42%	341	108 721
						4 102 245
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	102.72%	EUR	102.72%	0	51 359
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	100 000	100.15%	EUR	100.15%	30	100 184
BASGR Float 11/19	100 000	100.45%	EUR	100.45%		100 447
SAPGR Float 03/21	100 000	100.64%	EUR	100.64%		100 643
ACAFP Float 04/22	100 000	101.35%	EUR	101.35%	90	101 443
MCFP Float 11/18	60 000	100.19%	EUR	100.19%		60 111
BNP Float 06/24	100 000	100.88%	EUR	100.88%	29	100 909
RENAUL Float 03/2022	100 000	100.88%	EUR	100.88%	17	100 898
RENAULT Float 11/24	50 000	100.03%	EUR	100.03%	19	50 032

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ALDFP Float 11/20	100 000	100.33%	EUR	100.33%	9	100 337
HSBC Float 09/22	100 000	100.94%	EUR	100.94%	5	100 944
LLOYDS Float 06/2024	100 000	100.24%	EUR	100.24%	14	100 249
HSBC 0.17% 10/23	100 000	99.94%	EUR	99.94%	41	99 983
SANTAN Float 03/22	100 000	101.95%	EUR	101.95%	21	101 966
BKTSM 1.25% 02/28	200 000	101.55%	EUR	101.55%	363	203 465
SCANIA Float 04/20	100 000	100.36%	EUR	100.36%	14	100 370
BAC Float 05/23	100 000	100.85%	EUR	100.85%	69	100 922
MS Float 11/22	100 000	100.80%	EUR	100.80%	54	100 851
GM Float 05/21	100 000	100.65%	EUR	100.65%	47	100 700
T Float 09/2023	100 000	102.27%	EUR	102.27%	39	102 307
NDASS Float 09/21	100 000	101.24%	EUR	101.24%	2	101 239
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.36%	EUR	100.36%	57	100 416
VW Float 03/19	100 000	100.16%	EUR	100.16%	0	100 162
ALVGR Float 12/20	200 000	101.16%	EUR	101.16%	24	202 336
NYKRE Float 06/22	100 000	100.61%	EUR	100.61%	20	100 631
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.22%	EUR	100.22%	11	100 229
KBCBB Float 11/22	100 000	100.77%	EUR	100.77%	21	100 787
DLTAS 2008-1 A	76 722	100.00%	EUR	100.00%	4	76 726
SUMIBK Float 06/22	100 000	100.35%	EUR	100.35%	6	100 359
BCHINA Float 11/20	100 000	99.96%	EUR	99.96%	15	99 978
CAFP Float 03/2020	100 000	100.61%	EUR	100.61%	6	100 614
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.85%	EUR	100.85%	20	100 874
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.59%	EUR	100.59%	14	100 602
UPS Float 07/2020	100 000	100.69%	EUR	100.69%	21	100 715
DE Float 04/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%	4	100 433
GS Float 07/2022	75 000	101.95%	EUR	101.95%	91	76 554
GS Float 29/05/2020	125 000	100.70%	EUR	100.70%	41	125 920
BAC Float 05/2019	100 000	101.15%	EUR	101.15%	170	101 320
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.54%	EUR	100.54%		65 348
MMM Float 05/20	100 000	100.54%	EUR	100.54%		100 543
ANNGR Float 09/18	100 000	100.09%	EUR	100.09%	3	100 095
UNANA Float 06/18	100 000	100.04%	EUR	100.04%		100 040
ARRFP Float 01/2020	100 000	100.98%	EUR	100.98%	91	101 075
POHBK Float 03/20	100 000	100.47%	EUR	100.47%		100 471
SKYLN Float 04/20	100 000	100.94%	EUR	100.94%	104	101 047
VOD Float 02/2019	100 000	100.78%	EUR	100.78%	59	100 841
CAT Float 05/2018	100 000	100.02%	EUR	100.02%		100 022
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.57%	EUR	100.57%		150 851
ISPIM Float 04/2019	100 000	100.84%	EUR	100.84%	148	100 987
GE Float 01/2020	100 000	100.33%	EUR	100.33%	10	100 337
GIS Float 01/2020	100 000	100.97%	EUR	100.97%	84	101 056
BMW Float 03/2019	100 000	100.28%	EUR	100.28%	2	100 284
MCD Float 08/2019	100 000	100.36%	EUR	100.36%		100 355
						5 340 006

Acções

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SIEMENS	269	103.52	EUR	103.52		27 847
ALLIANZ	77	183.40	EUR	183.40		14 122
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 179	9.02	EUR	9.02		10 635
BASF	414	82.47	EUR	82.47		34 143
BAYER AG	403	91.79	EUR	91.79		36 991
ADIDAS- SALOMON AG	127	196.65	EUR	196.65		24 975
SAP SE	297	84.97	EUR	84.97		25 236
LUFTHANSA	817	25.94	EUR	25.94		21 193
DEUTSCHE TELEKOM	1 390	13.25	EUR	13.25		18 418
DAIMLER CHRYSLER	720	68.97	EUR	68.97		49 658
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	21.74	EUR	21.74		32 175
DEUTSCHE POST	988	35.52	EUR	35.52		35 094
VOLKSWAGEN AG-PREF.	372	161.38	EUR	161.38		60 033
RHEINMETALL AG	308	114.95	EUR	114.95		35 405
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	62.06	EUR	62.06		33 202
COVESTRO AG	142	79.86	EUR	79.86		11 340
VONOVIA SE	233	40.25	EUR	40.25		9 378
DANONE	654	65.73	EUR	65.73		42 987
TOTAL SA	1 069	46.13	EUR	46.13		49 313
Kering	106	388.80	EUR	388.80		41 213
BNP	154	60.17	EUR	60.17		9 266
AIR LIQUIDE	176	99.48	EUR	99.48		17 508
SCHNEIDER	290	71.34	EUR	71.34		20 689
L.V.M.H.	267	250.20	EUR	250.20		66 803
ACCOR	243	43.85	EUR	43.85		10 656
ORANGE	2 600	13.79	EUR	13.79		35 841
GLE ENTREP. VINCI	254	79.90	EUR	79.90		20 295
SANOFI SYNHLABO	243	65.33	EUR	65.33		15 875
AIRBUS SE	456	93.80	EUR	93.80		42 773
ARKEMA	96	106.00	EUR	106.00		10 176
HSBC HOLDINGS	3 200	6.65	GBP	7.60		24 306
DIAGEO ORD.	344	24.12	GBP	27.53		9 471
3I GROUP	3 088	8.59	GBP	9.81		30 279
Imperial Brands PLC	298	24.26	GBP	27.69		8 252
RECKITT BENCKISER	168	60.34	GBP	68.88		11 572
OCADO GROUP PLC	1 605	5.31	GBP	6.06		9 725
ASHTREAD GROUP PLC	995	19.40	GBP	22.15		22 034
SHIRE PLC	571	35.71	GBP	40.76		23 272
AMADEUS HOLDING SA	495	59.98	EUR	59.98		29 690
ROYAL DUTCH SHELL B	438	22.77	GBP	25.99		11 384
ROTORK PLC	6 950	2.84	GBP	3.25		22 555
TELEFONICA	4 294	8.03	EUR	8.03		34 472
BCO SANTANDER C.HISP	12 038	5.30	EUR	5.30		63 741
IBERDROLA	2 906	5.97	EUR	5.97		17 355
REPSOL	747	14.42	EUR	14.42		10 768
MASMOVIL IBERCOM	128	120.00	EUR	120.00		15 360
MEDIOBANCA	3 210	9.55	EUR	9.55		30 649

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BANCA INTESA	9 521	2.95	EUR	2.95		28 120
ENEL	4 172	4.97	EUR	4.97		20 735
FINECOBANK SPA	2 917	9.77	EUR	9.77		28 493
CATTOLICA ASSIC	3 932	8.65	EUR	8.65		34 012
ESSITY AKTIEBO-B	469	230.60	SEK	22.43		10 520
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	19.24	EUR	19.24		7 851
ING GROEP NV	4 518	13.70	EUR	13.70		61 897
UNILEVER NV-CVA	1 215	45.87	EUR	45.87		55 732
ASML NA	395	160.15	EUR	160.15		63 259
AKZO NOBEL NV NLG20	173	76.74	EUR	76.74		13 276
ABN AMRO GROUP NV	913	24.47	EUR	24.47		22 341
VESTAS WIND SYSTEMS	167	429.80	DKK	57.65		9 628
ANHEUSER-BUSCH INB	676	89.28	EUR	89.28		60 353
BPOST SA	700	18.36	EUR	18.36		12 852
OMV AG	278	47.28	EUR	47.28		13 144
ERST BK DER OEST.SPA	698	40.80	EUR	40.80		28 478
RAIFFEISEN INTL BK H	1 128	31.59	EUR	31.59		35 634
AIB GROUP PLC	3 763	4.89	EUR	4.89		18 409
ARCELOR MITTAL	808	25.70	EUR	25.70		20 766
						1 783 625
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					6	200 072
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	99.93%	EUR	99.93%	4	99 931
AGN Float 06/19	100 000	100.14%	EUR	100.14%	2	100 141
						200 072
						12 027 141

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						3 695 691
CXG OBRIGAÇÕES	390 013	4.47	EUR	4.47		1 744 058
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.73	EUR	3.73		718 648
CXG PRIVATE EQUITY	22 736	5.67	EUR	5.67		128 813
CXG INFRAESTRUTURAS	34 705	6.64	EUR	6.64		230 403
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.34	EUR	5.34		601 584
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	5.21	EUR	5.21		87 603
FUNDIESTAMO I	58	1 039.86	EUR	1 039.86		60 312
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.30	EUR	10.30		74 259
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	2.98	EUR	2.98		50 011
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						7 478 202
BROCK EURO MKT Fd D2	35 038	31.75	EUR	31.75		1 112 457
Amundi Funds II-Eur	121 886	9.02	EUR	9.02		1 099 412
Janus Hend H. Pan Al	1 764	16.62	EUR	16.62		29 318
Schroder ISF Euro Eq	25 669	44.14	EUR	44.14		1 133 130
MERRILL LYNCH MARSH	469	144.22	EUR	144.22		67 639
JAN HND UK Abs Ret	9 278	7.13	EUR	7.13		66 114
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.72	EUR	1.72		45 614

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 331.35	EUR	1 331.35		50 591
SCH EUROP ALPHA ABS	431	106.22	EUR	106.22		45 782
LYXOR EPSILON GLOB E	281	128.85	EUR	128.85		36 205
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 735.48	EUR	1 735.48		1 084 675
Janus Hend Horiz Eur	77 610	14.21	EUR	14.21		1 102 838
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 024.81	EUR	1 024.81		114 779
DNCA INVEST-MIURA-I	181	131.36	EUR	131.36		23 776
ISHARES STOXX EU 600	6 630	17.26	EUR	17.26		114 407
HYPO DJ ESTX 50 FRA	21 267	33.61	EUR	33.61		714 784
ISHARES S&P 500 MONT	10 733	59.32	EUR	59.32		636 682
OIC domici. em Estados não membros da EU						364 100
ISHARES MSCI EMER.MK	9 331	47.96	USD	39.02		364 100
						11 537 993

LIQUIDEZ

À vista						1 352 966
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			396
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			6 179
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 318 064
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 517
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			57
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			53
DO CGD - USD 0.0000%			USD			4 037
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			22 662
						1 352 966
						1 352 966

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						19 623
Valores Passivos						-72 101
						-52 477
						24 865 622

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

Em mercado regulamentado

Futuros

TYM8-USD CBT 06/18	-6	121.16	USD	98.57		-591 439
--------------------	----	--------	-----	-------	--	----------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

4 013 835.28

Valor da Unidade de Participação: € 6.1950