

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

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.					952	141 161
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	86 000	97.18%	EUR	97.18%	721	84 298
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	103.30%	EUR	103.30%	231	41 551
Acções						
EDP Renováveis	1 792	8.55	EUR	8.55		15 313
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					57 100	11 804 409
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	230 000	134.71%	EUR	134.71%	9 452	319 283
DBR 5.5% 01/04/31	140 000	160.81%	EUR	160.81%	5 063	230 194
DBR 4% 04/01/37	195 000	156.41%	EUR	156.41%	5 129	310 130
DBR 3.25% 01/2020	790 000	105.28%	EUR	105.28%	16 882	848 610
DBR 2.5% 07/2044	197 000	136.03%	EUR	136.03%	796	268 771
DBR 1.5% 02/2023	45 000	108.29%	EUR	108.29%	366	49 095
DBR 1.75% 2/2024	130 000	110.76%	EUR	110.76%	1 234	145 218
BKO 0% 09/18	500 000	99.95%	EUR	99.95%		499 730
BKO 0% 12/18	163 000	100.08%	EUR	100.08%		163 132
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	161.73%	EUR	161.73%	2 068	212 310
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	139.01%	EUR	139.01%	264	41 967
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	122.37%	EUR	122.37%	2 941	131 424
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	104.58%	EUR	104.58%	790	199 486
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	141.92%	EUR	141.92%	212	71 170
SPGB 3.45% 07/66	51 000	114.06%	EUR	114.06%	159	58 330
SPGB 0.45% 10/22	286 000	100.84%	EUR	100.84%	1 075	289 484
BTPS 4% 2/2037	170 000	105.47%	EUR	105.47%	573	179 874
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	109.42%	EUR	109.42%	320	87 859
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	103.25%	EUR	103.25%	106	5 269
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	108.07%	EUR	108.07%	1 624	118 344
BTPS 4.5% 03/2024	90 000	108.12%	EUR	108.12%	2 025	99 329
SPGB 6% 31/01/2029	80 000	143.47%	EUR	143.47%	2 801	117 576
						4 446 584
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	102.39%	EUR	102.39%	6	51 201
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	100 000	99.38%	EUR	99.38%	22	99 400
BASGR Float 11/19	100 000	100.29%	EUR	100.29%		100 285
SAPGR Float 03/21	100 000	100.43%	EUR	100.43%		100 434
ACAFP Float 04/22	100 000	100.50%	EUR	100.50%	57	100 559
MCFP Float 11/18	60 000	100.07%	EUR	100.07%		60 040
BNP Float 06/24	100 000	99.96%	EUR	99.96%	102	100 057
RENAUL Float 03/2022	100 000	100.12%	EUR	100.12%	77	100 199
RENAULT Float 11/24	50 000	98.62%	EUR	98.62%	10	49 317

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ALDFP Float 11/20	100 000	100.02%	EUR	100.02%	2	100 021
HSBC Float 09/22	100 000	100.52%	EUR	100.52%	69	100 585
LLOYDS Float 06/2024	100 000	99.74%	EUR	99.74%	91	99 829
HSBC 0.17% 10/23	100 000	99.70%	EUR	99.70%	29	99 731
SANTAN Float 03/22	100 000	101.08%	EUR	101.08%	139	101 219
BKTSM 1.25% 02/28	200 000	101.88%	EUR	101.88%	1 411	205 161
SCANIA Float 04/20	100 000	100.19%	EUR	100.19%	9	100 197
BAC Float 05/23	100 000	100.58%	EUR	100.58%	33	100 614
MS Float 11/22	100 000	100.35%	EUR	100.35%	25	100 377
GM Float 05/21	100 000	100.46%	EUR	100.46%	22	100 481
T Float 09/2023	100 000	101.00%	EUR	101.00%	131	101 127
MS Float 05/21	100 000	99.93%	EUR	99.93%	2	99 936
NDASS Float 09/21	100 000	100.86%	EUR	100.86%	32	100 892
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.13%	EUR	100.13%	15	100 149
VW Float 03/19	100 000	100.08%	EUR	100.08%	5	100 083
ALVGR Float 12/20	200 000	100.91%	EUR	100.91%	85	201 903
DAIGR Float 04/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%	27	100 461
NYKRE Float 06/22	100 000	99.89%	EUR	99.89%	62	99 954
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.29%	EUR	100.29%	42	100 327
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.03%	EUR	100.03%	50	100 077
KBCBB Float 11/22	100 000	99.83%	EUR	99.83%	5	99 838
DLTAS 2008-1 A	70 726	99.50%	EUR	99.50%	4	70 374
SUMIBK Float 06/22	100 000	99.77%	EUR	99.77%	28	99 798
MIZUHO Float 04/23	100 000	100.10%	EUR	100.10%	26	100 123
BCHINA Float 11/20	100 000	99.88%	EUR	99.88%	4	99 884
CAFP Float 03/2020	100 000	100.34%	EUR	100.34%	38	100 381
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.51%	EUR	100.51%	69	100 583
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.45%	EUR	100.45%	9	100 454
UPS Float 07/2020	100 000	100.62%	EUR	100.62%	14	100 636
DE Float 04/20	100 000	100.32%	EUR	100.32%	3	100 323
GS Float 07/2022	75 000	101.64%	EUR	101.64%	52	76 283
GS Float 29/05/2020	125 000	100.77%	EUR	100.77%	4	125 971
BAC Float 05/2019	100 000	100.68%	EUR	100.68%	82	100 760
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.38%	EUR	100.38%		65 248
MMM Float 05/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%		100 428
ANNGR Float 09/18	100 000	100.01%	EUR	100.01%	13	100 019
ARRFP Float 01/2020	100 000	100.68%	EUR	100.68%	63	100 747
POHBK Float 03/20	100 000	100.31%	EUR	100.31%		100 310
SKYLN Float 04/20	100 000	100.75%	EUR	100.75%	72	100 821
VOD Float 02/2019	100 000	100.40%	EUR	100.40%	9	100 405
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.41%	EUR	100.41%		150 609
ISPIM Float 04/2019	100 000	100.14%	EUR	100.14%	93	100 233
GE Float 01/2020	100 000	100.26%	EUR	100.26%	7	100 267
GIS Float 01/2020	100 000	100.80%	EUR	100.80%	53	100 852
BMW Float 03/2019	100 000	100.15%	EUR	100.15%	12	100 162
MCD Float 08/2019	100 000	100.20%	EUR	100.20%		100 203
						5 519 131

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Ações						
SIEMENS	678	111.98	EUR	111.98		75 922
ALLIANZ	77	183.64	EUR	183.64		14 140
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 179	9.18	EUR	9.18		10 823
BASF	414	79.69	EUR	79.69		32 992
BAYER AG	439	80.38	EUR	80.38		35 287
ADIDAS- SALOMON AG	168	214.90	EUR	214.90		36 103
SAP SE	297	103.62	EUR	103.62		30 775
DEUTSCHE TELEKOM	1 390	13.91	EUR	13.91		19 335
DAIMLER CHRYSLER	286	55.70	EUR	55.70		15 930
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	21.92	EUR	21.92		32 442
VOLKSWAGEN AG-PREF.	372	140.84	EUR	140.84		52 392
LEONI AG	749	37.13	EUR	37.13		27 810
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	65.78	EUR	65.78		35 192
COVESTRO AG	177	73.38	EUR	73.38		12 988
DANONE	567	67.82	EUR	67.82		38 454
PERNOD RICARD	70	136.00	EUR	136.00		9 520
TOTAL SA	1 607	53.87	EUR	53.87		86 569
Kering	81	468.00	EUR	468.00		37 908
PEUGEOT CITROEN	1 928	23.70	EUR	23.70		45 694
BNP	154	50.58	EUR	50.58		7 789
AIR LIQUIDE	209	108.50	EUR	108.50		22 677
SCHNEIDER	161	70.24	EUR	70.24		11 309
L.V.M.H.	226	301.85	EUR	301.85		68 218
ORANGE	2 372	13.95	EUR	13.95		33 089
GLE ENTREP. VINCI	156	82.56	EUR	82.56		12 879
SANOFI SYNHLABO	243	73.69	EUR	73.69		17 907
AIRBUS SE	473	106.26	EUR	106.26		50 261
ARKEMA	96	107.90	EUR	107.90		10 358
SAFRAN SA	383	112.30	EUR	112.30		43 011
3I GROUP	1 808	8.96	GBP	10.02		18 117
RECKITT BENCKISER	168	65.59	GBP	73.32		12 318
WEIR GROUP PLC	736	18.75	GBP	20.95		15 422
OCADO GROUP PLC	1 605	10.73	GBP	11.99		19 243
ADMIRAL GROUP PLC	1 581	20.80	GBP	23.25		36 761
ASHTED GROUP PLC	638	23.62	GBP	26.40		16 846
SHIRE PLC	571	44.99	GBP	50.29		28 714
AMADEUS HOLDING SA	429	79.92	EUR	79.92		34 286
ROYAL DUTCH SHELL B	492	25.41	GBP	28.40		13 973
ROTORK PLC	4 294	3.38	GBP	3.78		16 224
TELEFONICA	3 826	6.99	EUR	6.99		26 732
BCO SANTANDER C.HISP	15 226	4.29	EUR	4.29		65 289
IBERDROLA	2 906	6.42	EUR	6.42		18 662
MASMOVIL IBERCOM	128	97.30	EUR	97.30		12 454
UNICREDITO ITALIANO	1 817	12.43	EUR	12.43		22 593
ENI SPA	547	15.98	EUR	15.98		8 741

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BANCA INTESA	8 591	2.13	EUR	2.13		18 277
ENEL	3 536	4.26	EUR	4.26		15 063
ESSITY AKTIEBO-B	469	237.00	SEK	22.31		10 464
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	20.96	EUR	20.96		8 552
ING GROEP NV	4 007	11.69	EUR	11.69		46 842
UNILEVER NV-CVA	1 274	49.55	EUR	49.55		63 120
ASML NA	327	175.64	EUR	175.64		57 434
AKZO NOBEL NV NLG20	173	80.52	EUR	80.52		13 930
ABN AMRO GROUP NV	1 741	23.33	EUR	23.33		40 618
ASR NEDERLAND NV	967	41.10	EUR	41.10		39 744
EURONEXT NV	335	56.60	EUR	56.60		18 961
VESTAS WIND SYSTEMS	174	447.50	DKK	60.02		10 444
ANHEUSER-BUSCH INB	728	80.65	EUR	80.65		58 713
ERST BK DER OEST.SPA	698	34.27	EUR	34.27		23 920
RAIFFEISEN INTL BK H	1 276	24.50	EUR	24.50		31 262
TENARIS SA	1 310	14.45	EUR	14.45		18 930
ARCELOR MITTAL	658	25.94	EUR	25.94		17 069
						1 787 493
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					25	297 676
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	98.26%	EUR	98.26%	13	98 275
F Float 05/21	100 000	99.32%	EUR	99.32%	6	99 321
AGN Float 06/19	100 000	100.07%	EUR	100.07%	7	100 081
						297 676
						12 243 247
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						3 597 664
CXG OBRIGAÇÕES	390 013	4.45	EUR	4.45		1 736 336
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.85	EUR	3.85		742 554
CXG PRIVATE EQUITY	16 936	5.77	EUR	5.77		97 682
CXG INFRAESTRUTURAS	27 450	7.17	EUR	7.17		196 756
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.33	EUR	5.33		600 626
F.IMOB.IMOSOCIAL	16 827	3.21	EUR	3.21		53 989
FUNDIESTAMO I	58	1 062.99	EUR	1 062.99		61 653
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.38	EUR	10.38		74 827
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	1.98	EUR	1.98		33 240
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						8 194 204
BROCK EURO MKT Fd D2	35 038	32.62	EUR	32.62		1 142 940
Amundi Funds II-Eur	121 886	9.48	EUR	9.48		1 155 479
Janus Hend H. Pan Al	1 764	16.70	EUR	16.70		29 459
Schroder ISF Euro Eq	25 669	45.56	EUR	45.56		1 169 446
MERRILL LYNCH MARSH	469	146.11	EUR	146.11		68 526
JAN HND UK Abs Ret	9 278	7.21	EUR	7.21		66 886
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.65	EUR	1.65		43 760
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 341.78	EUR	1 341.78		50 988

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SCH EUROP ALPHA ABS	431	104.90	EUR	104.90		45 211
LYXOR EPSILON GLOB E	281	126.73	EUR	126.73		35 612
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 881.64	EUR	1 881.64		1 176 025
Janus Hend Horiz Eur	77 610	14.55	EUR	14.55		1 129 226
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 018.71	EUR	1 018.71		114 096
DNCA INVEST-MIURA-I	181	123.82	EUR	123.82		22 411
HYPO DJ ESTX 50 FRA	24 779	34.45	EUR	34.45		853 513
ISHARES S&P 500 MONT	16 766	65.05	EUR	65.05		1 090 628
						11 791 868

LIQUIDEZ

À vista						914 985
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			415
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			159
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			885 882
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			740
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			57
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			35
DO CGD - USD 0.0000%			USD			461
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			27 235
						914 985
						914 985

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						6 868
Valores Passivos						-50 263
						-43 395
						24 906 704

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

TYU8 USD CBT 09/18	-5	120.45	USD	103.87		-519 374
--------------------	----	--------	-----	--------	--	----------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

3 986 934.40

Valor da Unidade de Participação: € 6.2471