

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-04-30

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.					24 472	1 529 710
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	950 000	123.49%	EUR	123.49%	24 221	1 197 357
PGB 2.25% 04/34	313 000	100.10%	EUR	100.10%	251	313 551
						1 510 908
Acções						
EDP Renováveis	2 362	7.96	EUR	7.96		18 802
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						407 346
Títulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	407 000	100.09%	EUR	100.09%		407 346
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					161 641	63 736 116
Títulos de Dívida Pública						
DBR 5.5% 01/04/31	1 000 000	158.09%	EUR	158.09%	17 630	1 598 490
DBR 3.25% 01/2020	920 000	106.55%	EUR	106.55%	9 584	989 835
DBR 3% 07/2020	998 000	107.76%	EUR	107.76%	24 690	1 100 095
DBR 2.5% 07/2044	600 000	129.95%	EUR	129.95%	12 370	792 070
DBR 1.5% 02/2023	1 100 000	107.79%	EUR	107.79%	3 390	1 189 047
DBR 1.5% 05/2023	481 000	107.90%	EUR	107.90%	6 938	525 923
DBR 1.75% 2/2024	455 000	109.78%	EUR	109.78%	1 636	501 126
BKO 0% 09/18	2 320 000	100.18%	EUR	100.18%		2 324 176
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	160.98%	EUR	160.98%	247	537 934
FRTR 3% 04/2022	960 000	112.66%	EUR	112.66%	473	1 081 961
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	137.66%	EUR	137.66%	8 957	415 060
SPGB 4.6% 07/2019	805 000	106.28%	EUR	106.28%	27 899	883 461
SPGB 5.15% 10/2044	250 000	158.74%	EUR	158.74%	6 420	403 267
SPGB 3.45% 07/66	271 000	122.09%	EUR	122.09%	7 044	337 911
SPGB0.4% 04/22	290 000	101.31%	EUR	101.31%	3	293 793
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	101.11%	EUR	101.11%	2 744	1 239 368
BTPS 4.75% 08/2023	305 000	120.77%	EUR	120.77%	3 562	371 907
BTPS 5% 03/2025	514 000	125.10%	EUR	125.10%	4 260	647 248
BTPS 4.5% 05/2023	254 000	118.74%	EUR	118.74%	5 715	307 317
BTPS 4.5% 03/2024	400 000	120.22%	EUR	120.22%	2 984	483 852
						16 023 843
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	102.65%	EUR	102.65%	15	410 627
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	100.17%	EUR	100.17%	104	1 101 985
VW Float 07/19	200 000	100.19%	EUR	100.19%	3	200 373
VW Float 07/21	200 000	100.11%	EUR	100.11%	17	200 227
BASGR Float 11/19	200 000	100.41%	EUR	100.41%		200 816
SAPGR Float 03/21	300 000	100.63%	EUR	100.63%		301 881
VW Float 10/19	200 000	100.19%	EUR	100.19%	2	200 382

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ACAFP Float 04/22	900 000	101.35%	EUR	101.35%	130	912 262
MCFP Float 11/18	200 000	100.16%	EUR	100.16%		200 316
BNP Float 06/24	600 000	100.94%	EUR	100.94%	388	606 016
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.88%	EUR	100.88%	183	403 691
RENAULT Float 11/24	800 000	99.96%	EUR	99.96%	462	800 110
ALDFP Float 11/20	300 000	100.26%	EUR	100.26%	54	300 831
HSBC Float 09/22	350 000	101.02%	EUR	101.02%	126	353 682
SANUK Float 05/23	200 000	100.34%	EUR	100.34%	178	200 860
RBS Float 06/20	500 000	100.32%	EUR	100.32%	77	501 682
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	100.37%	EUR	100.37%	514	1 004 174
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	100.03%	EUR	100.03%	124	1 000 454
RBS Float 03/2020	200 000	100.24%	EUR	100.24%	24	200 500
IBESM Float 02/24	700 000	100.88%	EUR	100.88%	466	706 643
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.90%	EUR	101.90%	787	1 019 767
BBVASM Float 04/22	1 100 000	101.21%	EUR	101.21%	157	1 113 423
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	101.29%	EUR	101.29%	1 137	406 305
SCANIA Float 10/18	100 000	100.11%	EUR	100.11%	0	100 114
SCANIA Float 04/20	300 000	100.25%	EUR	100.25%	7	300 769
SRGIM Float 08/24	1 000 000	99.65%	EUR	99.65%	176	996 666
FCABNK Float 06/21	100 000	99.79%	EUR	99.79%	0	99 791
MS Float 01/22	300 000	100.73%	EUR	100.73%	12	302 214
BAC Float 02/22	200 000	100.97%	EUR	100.97%	217	202 157
BAC Float 05/23	450 000	100.74%	EUR	100.74%	480	453 810
GM Float 05/21	800 000	100.74%	EUR	100.74%	608	806 544
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.18%	EUR	100.18%		1 001 790
BATSLN Float 08/21	500 000	100.21%	EUR	100.21%	177	501 212
GS Float 09/23	300 000	99.86%	EUR	99.86%	87	299 676
T Float 09/2023	1 000 000	102.06%	EUR	102.06%	828	1 021 438
C Float 03/23	500 000	100.09%	EUR	100.09%	97	500 522
GM Float 03/22	300 000	100.15%	EUR	100.15%	66	300 504
BAC FLOAT 04/24	400 000	100.00%	EUR	100.00%	25	400 009
NDASS Float 09/21	400 000	101.20%	EUR	101.20%	67	404 859
UBS Float 04/2021	500 000	100.70%	EUR	100.70%	19	503 509
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.33%	EUR	100.33%	818	803 426
VW Float 03/19	200 000	100.14%	EUR	100.14%	4	200 292
DAIGR Float 05/22	100 000	100.26%	EUR	100.26%		100 256
MYL Float 05/20	200 000	100.15%	EUR	100.15%	63	200 363
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.26%	EUR	100.26%	26	601 580
AEGON 0.375% 11/24	100 000	98.43%	EUR	98.43%	165	98 595
ALVGR Float 12/20	500 000	101.12%	EUR	101.12%	132	505 707
DAIGR Float 04/20	200 000	100.64%	EUR	100.64%	20	201 296
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.42%	EUR	100.42%	1	502 121
NYKRE Float 06/22	700 000	100.60%	EUR	100.60%	284	704 512
JYBC Float 06/20	400 000	100.41%	EUR	100.41%	15	401 667
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.43%	EUR	100.43%	104	401 820
KBCBB Float 11/22	400 000	100.75%	EUR	100.75%	158	403 158
DLTAS 2008-1 A	679 704	100.00%	EUR	100.00%	27	679 731

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DE Float 09/20	100 000	100.41%	EUR	100.41%		100 408
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.36%	EUR	100.36%	82	501 862
MIZUHO Float 04/23	500 000	100.34%	EUR	100.34%	50	501 740
NAB Float 04/2021	300 000	101.31%	EUR	101.31%	24	303 939
BMO Float 09/21	200 000	100.86%	EUR	100.86%	32	201 750
BMO Float 03/22	200 000	100.76%	EUR	100.76%	46	201 562
BCHINA Float 11/20	400 000	100.00%	EUR	100.00%	107	400 091
BNFP Float 01/2020	700 000	100.36%	EUR	100.36%	0	702 541
CAFP Float 03/2020	800 000	100.59%	EUR	100.59%	175	804 855
BFCM Float 03/2019	700 000	100.61%	EUR	100.61%	320	704 576
CBAAU Float 01/2020	700 000	100.58%	EUR	100.58%	11	704 099
UPS Float 07/2020	200 000	100.71%	EUR	100.71%	8	201 434
DE Float 04/20	300 000	100.43%	EUR	100.43%	1	301 285
JPM Float 01/2020	300 000	100.79%	EUR	100.79%	7	302 368
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.58%	EUR	100.58%	335	603 839
MS Float 11/19	250 000	100.88%	EUR	100.88%	181	252 388
GS Float 07/2022	600 000	101.95%	EUR	101.95%	56	611 732
GS Float 29/05/2020	750 000	100.77%	EUR	100.77%	481	756 263
BAC Float 05/2019	600 000	101.12%	EUR	101.12%	1 583	608 279
C Float 11/2019	700 000	100.67%	EUR	100.67%	335	705 025
CS Float 10/2019	700 000	100.58%	EUR	100.58%	35	704 081
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.52%	EUR	100.52%		201 048
MMM Float 05/20	800 000	100.54%	EUR	100.54%		804 352
ANNGR Float 09/18	200 000	100.08%	EUR	100.08%	14	200 168
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.60%	EUR	100.60%	309	805 101
UNANA Float 06/18	500 000	100.02%	EUR	100.02%		500 110
POHBK Float 03/20	500 000	100.47%	EUR	100.47%		502 330
RY Float 03/2019	300 000	100.38%	EUR	100.38%	35	301 166
SKYLN Float 04/20	300 000	100.92%	EUR	100.92%	98	302 858
CAT Float 05/2018	500 000	100.01%	EUR	100.01%		500 025
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.47%	EUR	100.47%		502 330
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.56%	EUR	100.56%		301 668
FDX Float 04/19	300 000	100.41%	EUR	100.41%	37	301 264
CAPFP Float 07/2018	300 000	100.05%	EUR	100.05%	122	300 278
VW Float 07/2018	200 000	100.04%	EUR	100.04%		200 070
ISPIM Float 04/2019	500 000	100.81%	EUR	100.81%	140	504 175
ISPIM Float 06/20	800 000	101.59%	EUR	101.59%	755	813 451
GE Float 01/2020	1 000 000	100.31%	EUR	100.31%	12	1 003 122
GIS Float 01/2020	400 000	100.97%	EUR	100.97%	67	403 963
MCD Float 08/2019	300 000	100.34%	EUR	100.34%		301 020
						44 859 109
Ações						
SIEMENS	354	105.64	EUR	105.64		37 397
ALLIANZ	102	196.46	EUR	196.46		20 039
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.07	EUR	9.07		14 098
BASF	587	86.32	EUR	86.32		50 670

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BAYER AG	531	99.28	EUR	99.28		52 718
ADIDAS- SALOMON AG	168	203.90	EUR	203.90		34 255
SAP SE	392	92.42	EUR	92.42		36 229
LUFTHANSA	1 104	24.17	EUR	24.17		26 684
DEUTSCHE TELEKOM	1 833	14.50	EUR	14.50		26 569
DAIMLER CHRYSLER	1 105	65.50	EUR	65.50		72 378
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	21.28	EUR	21.28		42 028
DEUTSCHE POST	1 302	36.10	EUR	36.10		47 002
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	171.84	EUR	171.84		84 202
RHEINMETALL AG	405	108.65	EUR	108.65		44 003
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	63.34	EUR	63.34		44 465
COVESTRO AG	187	75.56	EUR	75.56		14 130
VONOVIA SE	307	41.61	EUR	41.61		12 774
DANONE	747	67.09	EUR	67.09		50 116
TOTAL SA	1 884	52.33	EUR	52.33		98 590
Kering	137	479.60	EUR	479.60		65 705
BNP	204	63.98	EUR	63.98		13 052
AIR LIQUIDE	250	108.05	EUR	108.05		27 013
SCHNEIDER	383	75.28	EUR	75.28		28 832
L.V.M.H.	235	289.30	EUR	289.30		67 986
ACCOR	321	46.87	EUR	46.87		15 045
ORANGE	3 300	15.12	EUR	15.12		49 880
GLE ENTREP. VINCI	335	83.10	EUR	83.10		27 839
SANOFI SYNHLABO	311	65.79	EUR	65.79		20 461
AIRBUS SE	601	97.40	EUR	97.40		58 537
ARKEMA	117	108.50	EUR	108.50		12 695
HSBC HOLDINGS	4 222	7.25	GBP	8.26		34 882
DIAGEO ORD.	461	25.89	GBP	29.49		13 594
3I GROUP	4 075	9.42	GBP	10.72		43 701
Imperial Brands PLC	392	26.05	GBP	29.66		11 628
RECKITT BENCKISER	219	57.02	GBP	64.94		14 222
OCADO GROUP PLC	2 109	5.38	GBP	6.13		12 932
ASHTREAD GROUP PLC	1 350	20.33	GBP	23.15		31 259
SHIRE PLC	753	38.66	GBP	44.03		33 156
AMADEUS HOLDING SA	565	60.70	EUR	60.70		34 296
ROYAL DUTCH SHELL B	783	26.02	GBP	29.63		23 200
ROTORK PLC	9 700	3.29	GBP	3.75		36 347
TELEFONICA	5 042	8.43	EUR	8.43		42 519
BCO SANTANDER C.HISP	15 885	5.37	EUR	5.37		85 350
IBERDROLA	3 831	6.42	EUR	6.42		24 580
REPSOL	985	15.85	EUR	15.85		15 612
MASMOVIL IBERCOM	169	119.60	EUR	119.60		20 212
MEDIOBANCA	4 235	10.07	EUR	10.07		42 625
BANCA INTESA	11 322	3.16	EUR	3.16		35 744
ENEL	4 661	5.27	EUR	5.27		24 554
FINECOBANK SPA	3 540	9.90	EUR	9.90		35 060
CATTOLICA ASSIC	5 279	8.84	EUR	8.84		46 666

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ESSITY AKTIEBO-B	619	223.00	SEK	21.07		13 043
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	20.01	EUR	20.01		10 763
ING GROEP NV	6 600	13.98	EUR	13.98		92 242
UNILEVER NV-CVA	1 521	47.45	EUR	47.45		72 171
ASML NA	432	157.50	EUR	157.50		68 040
AKZO NOBEL NV NLG20	227	74.90	EUR	74.90		17 002
ABN AMRO GROUP NV	1 204	25.73	EUR	25.73		30 979
VESTAS WIND SYSTEMS	220	400.20	DKK	53.71		11 817
ANHEUSER-BUSCH INB	891	82.72	EUR	82.72		73 704
BPOST SA	1 601	18.17	EUR	18.17		29 090
OMV AG	591	51.50	EUR	51.50		30 437
ERST BK DER OEST.SPA	949	40.60	EUR	40.60		38 529
RAIFFEISEN INTL BK H	1 681	28.00	EUR	28.00		47 068
AIB GROUP PLC	4 965	4.95	EUR	4.95		24 587
ARCELOR MITTAL	909	28.10	EUR	28.10		25 538
						2 442 537
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					351	1 807 526
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.27%	EUR	100.27%		300 807
F Float 12/21	500 000	99.90%	EUR	99.90%	36	499 511
UBS Float 09/22	700 000	100.92%	EUR	100.92%	304	706 765
AGN Float 06/19	300 000	100.14%	EUR	100.14%	11	300 443
						1 807 526
						67 480 698
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						14 413 592
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.47	EUR	4.47		9 841 316
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.75	EUR	3.75		2 809 336
CXG PRIVATE EQUITY	54 309	5.54	EUR	5.54		301 127
CXG INFRAESTRUTURAS	119 942	6.63	EUR	6.63		794 976
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.34	EUR	5.34		666 837
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						21 862 896
MS EUROCORP DURHED Z	180 722	29.88	EUR	29.88		5 399 973
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	32.92	EUR	32.92		1 853 462
Amundi Funds II-Eur	195 755	9.62	EUR	9.62		1 883 163
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.63	EUR	16.63		147 375
Schroder ISF Euro Eq	41 285	46.11	EUR	46.11		1 903 461
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	144.86	EUR	144.86		344 767
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.24	EUR	7.24		340 621
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.70	EUR	1.70		228 948
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 330.12	EUR	1 330.12		259 373
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	107.49	EUR	107.49		234 542
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	127.22	EUR	127.22		181 035
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 797.71	EUR	1 797.71		1 880 405
Janus Hend Horiz Eur	124 650	14.92	EUR	14.92		1 859 778

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 026.61	EUR	1 026.61		589 274
DNCA INVEST-MIURA-I	917	130.99	EUR	130.99		120 118
ISHARES STOXX EU 600	31 470	17.79	EUR	17.79		559 914
HYPO DJ ESTX 50 FRA	59 232	35.55	EUR	35.55		2 105 401
ISHARES S&P 500 MONT	32 713	60.26	EUR	60.26		1 971 285
OIC domici. em Estados não membros da EU						1 153 843
TISHMAN ESOF	91 579	0.26	EUR	0.26		23 750
ISHARES MSCI EMER.MK	28 890	47.23	USD	39.12		1 130 093
						37 430 332

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						3 236 983
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			260
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			219
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			3 044 369
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			2 863
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			101
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			348
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			13 332
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			175 470
						3 236 983
						3 236 983

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						22 246
Valores Passivos						-456 686
						-434 440
						115 219 973

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

TYM8-USD CBT 06/18	-17	119.59	USD	99.05		-1 683 861
--------------------	-----	--------	-----	-------	--	------------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 509 313.16

Valor da Unidade de Participação: € 13.5405