

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
 Composição da Carteira em 2017-10-31

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.					15 353	1 166 181
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	300 000	122.20%	EUR	122.20%	285	366 891
OT 4.125% 04/2027	220 000	117.41%	EUR	117.41%	7 136	265 440
						632 331
Obrigações diversas						
SANTAN 1.625% 06/19	200 000	102.77%	EUR	102.77%	1 273	206 807
CXGD 1% 01/2022	100 000	101.95%	EUR	101.95%	762	102 714
CXGD 3.75% 01/2018	200 000	100.83%	EUR	100.83%	5 897	207 559
						517 080
Acções						
EDP Renováveis	2 362	7.10	EUR	7.10		16 770
Outros Merc. Regulamentados Nacionais					20	407 041
Títulos de Dívida Pública						
BT 17NOV2017	407 000	100.01%	EUR	100.01%	20	407 041
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					192 426	56 835 957
Títulos de Dívida Pública						
DBR 4.75% 98/2028	690 000	145.28%	EUR	145.28%	10 775	1 013 214
DBR 4% 04/01/37	100 000	154.46%	EUR	154.46%	3 299	157 759
DBR 4% 01/2018	2 360 000	100.81%	EUR	100.81%	77 848	2 457 011
DBR 3% 07/2020	98 000	109.99%	EUR	109.99%	967	108 758
DBR 2.5% 07/2044	470 000	131.28%	EUR	131.28%	3 863	620 865
DBR 1.5% 02/2023	300 000	109.66%	EUR	109.66%	3 193	332 158
DBR 1.5% 05/2023	481 000	109.89%	EUR	109.89%	3 360	531 907
OBL 0.5% 02/2018	310 000	100.38%	EUR	100.38%	1 066	312 228
DBR 1.75% 2/2024	200 000	112.09%	EUR	112.09%	2 484	226 662
DBR 0.5% 02/2025	120 000	103.78%	EUR	103.78%	426	124 965
DBR 0.5% 08/27	800 000	101.31%	EUR	101.31%	1 205	811 717
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	160.57%	EUR	160.57%	7 824	544 138
FRTR 3% 04/2022	960 000	114.98%	EUR	114.98%	14 992	1 118 781
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	135.89%	EUR	135.89%	4 203	405 069
FRTR 1.75% 11/2024	61 000	111.22%	EUR	111.22%	997	68 844
SPGB 4.6% 07/2019	805 000	108.56%	EUR	108.56%	9 536	883 477
SPGB 4.4% 10/2023	350 000	122.56%	EUR	122.56%	42	429 006
SPGB 0.25% 04/2018	218 000	100.30%	EUR	100.30%	276	218 937
SPGB 3.45% 07/66	271 000	110.07%	EUR	110.07%	2 408	300 698
SPGB0.4% 04/22	873 000	100.85%	EUR	100.85%	1 770	882 164
BTPS 4.75% 08/2023	305 000	121.89%	EUR	121.89%	3 622	375 383
BTPS 5% 03/2025	514 000	125.66%	EUR	125.66%	4 331	650 233
BTPS 4.5% 05/2023	254 000	119.71%	EUR	119.71%	5 715	309 766
BTPS 4.5% 03/2024	400 000	120.95%	EUR	120.95%	3 033	486 829
BTPS 3.5% 03/2030	140 000	114.83%	EUR	114.83%	826	161 586

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
 Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TB 0.826% 02/2018	370 000	99.72%	USD	99.72%	1 942	318 417
						13 850 572
Obrigações diversas						
BCPPL 0.75% 05/22	200 000	101.12%	EUR	101.12%	633	202 867
DAIGR Float 07/24	1 100 000	100.44%	EUR	100.44%	107	1 104 969
VW Float 07/19	100 000	100.11%	EUR	100.11%	2	100 108
VW Float 07/21	200 000	100.26%	EUR	100.26%	17	200 535
ACAFP Float 04/22	700 000	102.17%	EUR	102.17%	110	715 272
MCFP Float 11/18	200 000	100.30%	EUR	100.30%		200 598
BNP Float 06/24	600 000	101.81%	EUR	101.81%	386	611 216
RENAUL Float 03/2022	400 000	101.33%	EUR	101.33%	181	405 497
HSBC Float 09/22	350 000	101.49%	EUR	101.49%	126	355 355
RBS Float 06/20	500 000	100.54%	EUR	100.54%	76	502 776
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.81%	EUR	101.81%	513	1 018 643
IBESM Float 02/24	700 000	101.01%	EUR	101.01%	477	707 579
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.79%	EUR	101.79%	786	1 018 666
BBVASM Float 04/22	1 000 000	101.12%	EUR	101.12%	151	1 011 361
SCANIA Float 10/18	100 000	100.23%	EUR	100.23%	0	100 228
SCANIA Float 04/20	300 000	100.39%	EUR	100.39%	7	301 183
SRGIM Float 08/24	1 000 000	100.44%	EUR	100.44%	177	1 004 557
MS Float 01/22	300 000	101.09%	EUR	101.09%	15	303 270
BAC Float 02/22	200 000	101.41%	EUR	101.41%	225	203 043
BAC Float 05/23	450 000	101.36%	EUR	101.36%	500	456 620
MS Float 11/22	300 000	101.18%	EUR	101.18%	263	303 803
GM Float 05/21	800 000	100.99%	EUR	100.99%	649	808 577
T Float 09/2023	1 000 000	102.83%	EUR	102.83%	825	1 029 085
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.30%	EUR	100.30%		1 002 960
BATSLN Float 08/21	500 000	100.69%	EUR	100.69%	183	503 633
NDASS Float 09/21	200 000	101.48%	EUR	101.48%	33	202 991
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.61%	EUR	100.61%	854	805 718
LANSNA 0.875% 02/27	300 000	100.33%	EUR	100.33%	1 863	302 847
VW Float 03/19	200 000	100.18%	EUR	100.18%	4	200 356
MYL Float 05/20	200 000	100.42%	EUR	100.42%	66	200 906
SYDBDC Float 05/18	400 000	100.18%	EUR	100.18%	174	400 898
BRF 0.5% 10/26	200 000	98.12%	EUR	98.12%	85	196 331
JYBC Float 06/20	400 000	100.48%	EUR	100.48%	14	401 918
KBCBB Float 11/22	400 000	101.07%	EUR	101.07%	170	404 462
DLTAS 2008-1 A	744 335	99.41%	EUR	99.41%	33	739 976
CGD S.758 12/2017	4 050 000	99.87%	EUR	99.87%	6 192	4 050 992
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.64%	EUR	100.64%	80	503 255
NAB Float 04/2021	300 000	101.53%	EUR	101.53%	26	304 622
BMO Float 09/21	200 000	101.26%	EUR	101.26%	32	202 548
BNFP Float 01/2020	700 000	100.48%	EUR	100.48%	0	703 332
CAFP Float 03/2020	800 000	100.66%	EUR	100.66%	175	805 439
BFCM Float 03/2019	700 000	100.97%	EUR	100.97%	319	707 123
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.71%	EUR	100.71%	12	704 989
DE Float 04/20	300 000	100.47%	EUR	100.47%	2	301 415

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
 Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
JPM Float 01/2020	300 000	101.03%	EUR	101.03%	9	303 105
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.86%	EUR	100.86%	350	605 522
MS Float 11/19	250 000	101.07%	EUR	101.07%	186	252 861
GS Float 07/2022	600 000	102.63%	EUR	102.63%	67	615 865
GS Float 29/05/2020	550 000	101.08%	EUR	101.08%	363	556 275
BAC Float 03/2018	300 000	100.14%	EUR	100.14%	145	300 559
BAC Float 05/2019	600 000	101.68%	EUR	101.68%	1 640	611 708
C Float 11/2019	700 000	100.84%	EUR	100.84%	354	706 199
CS Float 10/2019	700 000	100.81%	EUR	100.81%	38	705 687
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.54%	EUR	100.54%		201 072
MMM Float 05/20	600 000	100.53%	EUR	100.53%		603 168
ANNGR Float 09/18	200 000	100.15%	EUR	100.15%	13	200 317
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.88%	EUR	100.88%	309	807 357
UNANA Float 06/18	500 000	100.17%	EUR	100.17%		500 840
POHBK Float 03/20	500 000	100.59%	EUR	100.59%		502 945
RY Float 03/2019	300 000	100.59%	EUR	100.59%	35	301 817
SKYLN Float 04/20	300 000	101.20%	EUR	101.20%	105	303 708
ENELIM Float 02/2018	150 000	100.92%	EUR	100.92%	849	152 229
CAT Float 05/2018	500 000	100.09%	EUR	100.09%		500 455
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.61%	EUR	100.61%		503 065
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.70%	EUR	100.70%		302 106
FDX Float 04/19	300 000	100.53%	EUR	100.53%	39	301 632
CAPFP Float 07/2018	300 000	100.31%	EUR	100.31%	130	301 063
VW Float 07/2018	200 000	100.10%	EUR	100.10%		200 200
F Float 02/2018	800 000	100.08%	EUR	100.08%	262	800 862
ISPIM Float 04/2019	500 000	101.28%	EUR	101.28%	150	506 535
ISPIM Float 06/20	800 000	102.04%	EUR	102.04%	753	817 097
GE Float 01/2020	1 000 000	100.62%	EUR	100.62%	13	1 006 213
GIS Float 01/2020	400 000	101.30%	EUR	101.30%	71	405 251
MCD Float 08/2019	300 000	100.36%	EUR	100.36%		301 089
						40 489 321
Ações						
SIEMENS	784	122.50	EUR	122.50		96 040
ALLIANZ	226	199.35	EUR	199.35		45 053
E.ON AG(EX VEBAG AG)	1 554	10.13	EUR	10.13		15 742
BASF	468	93.62	EUR	93.62		43 814
BAYER AG	531	111.70	EUR	111.70		59 313
SAP SE	392	97.66	EUR	97.66		38 283
LUFTHANSA	1 314	27.40	EUR	27.40		36 004
DEUTSCHE TELEKOM	3 624	15.64	EUR	15.64		56 679
DAIMLER CHRYSLER	930	71.29	EUR	71.29		66 300
THYSSEN KRUPP	555	22.91	EUR	22.91		12 712
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	23.51	EUR	23.51		46 422
VOLKSWAGEN AG-PREF.	212	155.90	EUR	155.90		33 051
RHEINMETALL AG	122	101.49	EUR	101.49		12 382
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	71.71	EUR	71.71		50 340

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DEUTSCHE WOHNEN	420	36.57	EUR	36.57		15 357
ZALANDO SE	476	42.96	EUR	42.96		20 447
FRAPORT AG	309	81.46	EUR	81.46		25 171
DANONE	858	70.14	EUR	70.14		60 180
AXA-UAP	2 061	25.93	EUR	25.93		53 442
TOTAL SA	1 871	47.87	EUR	47.87		89 565
Kering	115	393.50	EUR	393.50		45 253
BNP	715	67.04	EUR	67.04		47 934
AIR LIQUIDE	145	109.30	EUR	109.30		15 849
SCHNEIDER	827	75.45	EUR	75.45		62 397
L.V.M.H.	331	256.10	EUR	256.10		84 769
GLE ENTREP. VINCI	732	84.05	EUR	84.05		61 525
SANOFI SYNHLABO	311	81.29	EUR	81.29		25 281
ARKEMA	179	108.45	EUR	108.45		19 413
ILIAD SA	86	214.35	EUR	214.35		18 434
DIAGEO ORD.	461	25.72	GBP	29.29		13 504
3I GROUP	3 640	9.61	GBP	10.95		39 841
Imperial Brands PLC	392	30.71	GBP	34.97		13 709
RECKITT BENCKISER	219	67.35	GBP	76.71		16 799
OCADO GROUP PLC	3 429	2.88	GBP	3.28		11 236
SHIRE PLC	753	37.21	GBP	42.38		31 912
AMADEUS HOLDING SA	640	58.25	EUR	58.25		37 280
ROYAL DUTCH SHELL B	400	24.22	GBP	27.58		11 032
INFORMA PLC	1 812	6.97	GBP	7.94		14 385
BCO SANTANDER C.HISP	19 576	5.82	EUR	5.82		113 991
IBERDROLA	3 831	6.94	EUR	6.94		26 579
REPSOL	1 183	16.09	EUR	16.09		19 029
INDITEX	1 421	32.10	EUR	32.10		45 607
TELECOM ITALIA	16 896	0.75	EUR	0.75		12 588
BANCA INTESA	26 161	2.89	EUR	2.89		75 501
ENEL	5 499	5.33	EUR	5.33		29 282
Leonardo SpA	1 669	14.83	EUR	14.83		24 751
AZIMUT HOLDING SPA	2 547	16.96	EUR	16.96		43 197
BREMBO SAP	2 108	14.18	EUR	14.18		29 891
FINECOBANK SPA	2 619	8.03	EUR	8.03		21 031
ESSITY AKTIEBO-B	619	250.30	SEK	25.65		15 879
ALFA LAVAL AB	1 422	212.10	SEK	21.74		30 911
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	16.16	EUR	16.16		8 691
ING GROEP NV	5 714	15.86	EUR	15.86		90 624
UNILEVER NV-CVA	1 602	49.91	EUR	49.91		79 948
ASML NA	521	154.80	EUR	154.80		80 651
AKZO NOBEL NV NLG20	227	77.74	EUR	77.74		17 647
ALTICE NV A-W/I	1 276	16.20	EUR	16.20		20 665
ABN AMRO GROUP NV	2 022	26.52	EUR	26.52		53 613
VESTAS WIND SYSTEMS	340	563.50	DKK	75.73		25 747
FLSMIDTH & CO A/S	441	438.00	DKK	58.86		25 958
PANDORA A/S	320	603.00	DKK	81.03		25 931

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ANHEUSER-BUSCH INB	891	105.05	EUR	105.05		93 600
CRH ORD	481	32.29	EUR	32.29		15 529
ARCELOR MITTAL	909	24.62	EUR	24.62		22 375
						2 496 064
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					313	1 351 471
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.43%	EUR	100.43%		301 281
UBS Float 09/22	700 000	101.43%	EUR	101.43%	303	710 299
AGN Float 06/19	300 000	100.15%	EUR	100.15%	10	300 469
						1 312 049
Acções						
JULIUS BAER GROUP LT	449	59.00	CHF	50.75		22 787
SUNRISE COM. GROUP	233	83.00	CHF	71.40		16 635
						39 422
						59 760 650

## UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						16 804 768
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.49	EUR	4.49		9 880 924
CXG IMOBILIARIO	773 940	3.67	EUR	3.67		2 838 657
CXG PRIVATE EQUITY	50 512	5.97	EUR	5.97		301 754
CXG INFRAESTRUTURAS	116 657	6.64	EUR	6.64		774 649
CXG LIQUIDEZ	563 464	5.34	EUR	5.34		3 008 785
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						32 135 652
SGAM FD ABSOL RETRN	89	1 072.17	EUR	1 072.17		95 423
MS EUROCORP DURHED Z	180 722	29.99	EUR	29.99		5 419 853
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	33.86	EUR	33.86		1 906 386
PIONEER EUROLND EQ I	195 755	9.67	EUR	9.67		1 892 951
BANTLEON OPPORTUNIT	8 395	177.44	EUR	177.44		1 489 609
BNY MELLON ABS RET	101 421	1.18	EUR	1.18		120 113
AXA WF EU CREDIT	31 224	136.84	EUR	136.84		4 272 692
Natixis Tresorie I	135	12 543.11	EUR	12 543.11		1 693 320
HENDERSON HPE.ALPHA	8 862	16.83	EUR	16.83		149 147
Schroder ISF Euro Eq	41 285	45.93	EUR	45.93		1 896 311
Theadneedle Credit O	159 980	1.36	EUR	1.36		217 109
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	146.08	EUR	146.08		347 670
PIONEER FUN RT CURRE	116	1 209.68	EUR	1 209.68		140 323
HENDERSON GART UK	47 051	7.27	EUR	7.27		342 141
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.70	EUR	1.70		229 716
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 308.86	EUR	1 308.86		255 228
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	109.51	EUR	109.51		238 953
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	120.96	EUR	120.96		172 125
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 843.24	EUR	1 843.24		1 928 029
MUZINICH LNG/SHT CRD	1 379	103.50	EUR	103.50		142 727
HENDERSON HORIZ.Euro	124 650	15.36	EUR	15.36		1 914 624

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BNP PARIBAS MOIS IC	73	23 107.16	EUR	23 107.16		1 686 823
HYPO DJ ESTX 50 FRA	65 673	36.54	EUR	36.54		2 399 363
ISHARES S&P 500 MONT	54 482	58.46	EUR	58.46		3 185 018
OIC domici. em Estados não membros da EU						23 825
TISHMAN ESOF	91 579	0.26	EUR	0.26		23 825
						48 964 245

OUTROS ACTIVOS

Imóveis						
R Rodrigo Fonseca	5	452 828.40	EUR	452 828.40		2 264 142
REPUBLICA 35- R/C	8	669 288.88	EUR	669 288.88		5 354 311
						7 618 453
						7 618 453

LIQUIDEZ

À vista						2 260 540
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			260
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			428
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			2 199 417
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			852
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			103
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			30
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			1 027
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			58 403
						2 260 540
						2 260 540

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						26 216
Valores Passivos						-142 298
						-116 082
						118 487 806

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

Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYZ7-USD CBT 12/17	-28	124.95	USD	107.18		-3 001 104

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 8 707 408.80

Valor da Unidade de Participação: € 13.6077