

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-01-31

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.					4 509	464 533
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	330 000	122.75%	EUR	122.75%	4 431	409 499
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	105.81%	EUR	105.81%	79	42 401
Acções						
EDP Renováveis	1 792	7.05	EUR	7.05		12 634
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						78 152
Títulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	78 000	100.20%	EUR	100.20%		78 152
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					33 694	11 046 361
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	130 000	135.60%	EUR	135.60%	623	176 898
DBR 2.5% 07/2044	148 000	127.79%	EUR	127.79%	2 149	191 280
DBR 1.5% 02/2023	33 000	107.29%	EUR	107.29%	476	35 880
OBL 0.5% 02/2018	243 000	100.00%	EUR	100.00%	1 142	244 139
DBR 1.75% 2/2024	130 000	109.23%	EUR	109.23%	2 188	144 180
BKO 0% 09/18	1 195 000	100.33%	EUR	100.33%		1 198 896
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	157.84%	EUR	157.84%	4 520	209 710
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	134.23%	EUR	134.23%	673	40 943
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	124.22%	EUR	124.22%	14	130 440
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	107.38%	EUR	107.38%	4 454	208 483
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	142.96%	EUR	142.96%	1 198	72 678
SPGB 3.45% 07/66	51 000	115.53%	EUR	115.53%	897	59 816
SPGB 0.45% 10/22	286 000	100.26%	EUR	100.26%	328	287 057
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	119.96%	EUR	119.96%	1 900	97 866
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	107.06%	EUR	107.06%	90	5 443
BTPS 5.5% 09/2022	176 000	121.38%	EUR	121.38%	4 091	217 715
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	118.05%	EUR	118.05%	1 235	128 731
BTPS 4.5% 03/2024	138 000	118.99%	EUR	118.99%	2 625	166 827
BTPS 3.5% 03/2030	215 000	111.88%	EUR	111.88%	3 180	243 712
						3 860 694
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	100 000	100.92%	EUR	100.92%	10	100 934
ACAFP Float 04/22	100 000	102.22%	EUR	102.22%	13	102 233
MCFP Float 11/18	60 000	100.23%	EUR	100.23%		60 140
BNP Float 06/24	100 000	102.41%	EUR	102.41%	66	102 473
RENAUL Float 03/2022	100 000	101.42%	EUR	101.42%	47	101 466
RENAULT Float 11/24	50 000	100.89%	EUR	100.89%	30	50 475
ALDFP Float 11/20	100 000	100.53%	EUR	100.53%	19	100 548
HSBC Float 09/22	100 000	101.54%	EUR	101.54%	37	101 572
LLOYDS Float 06/2024	100 000	102.35%	EUR	102.35%	53	102 403

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
HSBC 0.17% 10/23	100 000	100.76%	EUR	100.76%	13	100 772
SANTAN Float 03/22	100 000	102.56%	EUR	102.56%	81	102 642
BKTSM 1.25% 02/28	200 000	99.90%	EUR	99.90%		199 800
SCANIA Float 04/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%	2	100 428
BAC Float 05/23	100 000	101.85%	EUR	101.85%	109	101 961
MS Float 11/22	100 000	101.55%	EUR	101.55%	88	101 636
GM Float 05/21	100 000	101.03%	EUR	101.03%	81	101 109
T Float 09/2023	100 000	102.42%	EUR	102.42%	86	102 507
NDASS Float 09/21	100 000	101.47%	EUR	101.47%	17	101 485
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.47%	EUR	100.47%	107	100 573
VW Float 03/19	100 000	100.25%	EUR	100.25%	2	100 247
ALVGR Float 12/20	200 000	101.35%	EUR	101.35%	55	202 757
NYKRE Float 06/22	100 000	100.91%	EUR	100.91%	40	100 953
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.28%	EUR	100.28%	30	100 313
KBCBB Float 11/22	100 000	101.30%	EUR	101.30%	42	101 337
DLTAS 2008-1 A	79 120	99.94%	EUR	99.94%	4	79 080
SUMIBK Float 06/22	100 000	100.64%	EUR	100.64%	17	100 657
BCHINA Float 11/20	100 000	100.28%	EUR	100.28%	28	100 310
CAFP Float 03/2020	100 000	100.74%	EUR	100.74%	22	100 765
SANTAN Float 03/2020	100 000	101.08%	EUR	101.08%	44	101 119
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.69%	EUR	100.69%	2	100 695
UPS Float 07/2020	100 000	100.80%	EUR	100.80%	4	100 804
DE Float 04/20	100 000	100.51%	EUR	100.51%	1	100 506
GS Float 07/2022	75 000	102.85%	EUR	102.85%	8	77 144
GS Float 29/05/2020	75 000	101.12%	EUR	101.12%	49	75 889
BAC Float 05/2019	100 000	101.44%	EUR	101.44%	273	101 711
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.67%	EUR	100.67%		65 438
MMM Float 05/20	100 000	100.58%	EUR	100.58%		100 579
ANNGR Float 09/18	100 000	100.15%	EUR	100.15%	7	100 155
UNANA Float 06/18	100 000	100.11%	EUR	100.11%		100 106
ARRFP Float 01/2020	100 000	101.09%	EUR	101.09%	30	101 116
POHBK Float 03/20	100 000	100.57%	EUR	100.57%		100 572
SKYLN Float 04/20	100 000	101.22%	EUR	101.22%	35	101 254
VOD Float 02/2019	100 000	100.98%	EUR	100.98%	114	101 094
CAT Float 05/2018	100 000	100.06%	EUR	100.06%		100 060
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.74%	EUR	100.74%		151 107
MAERSK Float 03/19	100 000	101.61%	EUR	101.61%	159	101 769
F Float 02/2018	100 000	100.01%	EUR	100.01%	33	100 041
ISPIM Float 04/2019	100 000	101.08%	EUR	101.08%	30	101 109
GE Float 01/2020	100 000	100.49%	EUR	100.49%	1	100 493
GIS Float 01/2020	100 000	101.19%	EUR	101.19%	18	101 212
BMW Float 03/2019	100 000	100.35%	EUR	100.35%	6	100 356
MCD Float 08/2019	100 000	100.38%	EUR	100.38%		100 383
						5 306 285
Ações						
SIEMENS	202	122.16	EUR	122.16		24 676
ALLIANZ	77	203.50	EUR	203.50		15 670

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 179	8.46	EUR	8.46		9 973
BASF	414	94.32	EUR	94.32		39 048
BAYER AG	403	105.42	EUR	105.42		42 484
ADIDAS- SALOMON AG	198	187.30	EUR	187.30		37 085
SAP SE	297	90.83	EUR	90.83		26 977
LUFTHANSA	817	28.74	EUR	28.74		23 481
DEUTSCHE TELEKOM	981	14.13	EUR	14.13		13 857
DAIMLER CHRYSLER	720	73.73	EUR	73.73		53 086
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	23.41	EUR	23.41		34 647
DEUTSCHE POST	988	38.07	EUR	38.07		37 613
VOLKSWAGEN AG-PREF.	372	177.02	EUR	177.02		65 851
RHEINMETALL AG	308	113.90	EUR	113.90		35 081
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	70.48	EUR	70.48		37 707
1&1 Drillisch	439	67.00	EUR	67.00		29 413
COVESTRO AG	142	92.58	EUR	92.58		13 146
VONOVIA SE	233	39.71	EUR	39.71		9 252
DANONE	654	69.46	EUR	69.46		45 427
TOTAL SA	1 069	46.64	EUR	46.64		49 853
Kering	75	407.80	EUR	407.80		30 585
BNP	154	66.60	EUR	66.60		10 256
AIR LIQUIDE	176	108.55	EUR	108.55		19 105
SCHNEIDER	587	75.48	EUR	75.48		44 307
L.V.M.H.	217	252.60	EUR	252.60		54 814
ACCOR	315	45.85	EUR	45.85		14 443
BOUYGUES	452	44.77	EUR	44.77		20 236
GLE ENTREP. VINCI	513	87.00	EUR	87.00		44 631
SANOFI SYNHLABO	243	71.12	EUR	71.12		17 282
LEGRAND PROMESSES	232	67.02	EUR	67.02		15 549
ARKEMA	96	102.90	EUR	102.90		9 878
SAFRAN SA	248	90.94	EUR	90.94		22 553
ELIS SA	852	22.50	EUR	22.50		19 170
HSBC HOLDINGS	3 200	7.51	GBP	8.57		27 433
DIAGEO ORD.	344	25.33	GBP	28.91		9 944
3I GROUP	3 088	9.31	GBP	10.63		32 828
Imperial Brands PLC	298	28.99	GBP	33.08		9 859
RECKITT BENCKISER	168	68.03	GBP	77.65		13 045
OCADO GROUP PLC	1 605	5.04	GBP	5.75		9 226
SHIRE PLC	571	33.28	GBP	37.98		21 686
AMADEUS HOLDING SA	495	62.48	EUR	62.48		30 928
ROYAL DUTCH SHELL B	438	24.96	GBP	28.49		12 478
TELEFONICA	1 294	8.25	EUR	8.25		10 679
BCO SANTANDER C.HISP	12 038	5.98	EUR	5.98		72 023
IBERDROLA	2 906	6.56	EUR	6.56		19 058
REPSOL	747	15.16	EUR	15.16		11 321
INDITEX	344	28.87	EUR	28.87		9 931
MEDIOBANCA	3 210	9.79	EUR	9.79		31 432
BANCA INTESA	9 521	3.16	EUR	3.16		30 091

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ENEL	4 172	5.11	EUR	5.11		21 319
FINECOBANK SPA	2 917	10.01	EUR	10.01		29 199
CATTOLICA ASSIC	3 932	10.03	EUR	10.03		39 438
ESSITY AKTIEBO-B	469	236.00	SEK	24.11		11 308
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	17.97	EUR	17.97		7 332
ING GROEP NV	4 518	15.83	EUR	15.83		71 520
UNILEVER NV-CVA	1 215	46.65	EUR	46.65		56 680
ASML NA	395	163.20	EUR	163.20		64 464
AKZO NOBEL NV NLG20	173	75.42	EUR	75.42		13 048
ABN AMRO GROUP NV	913	27.29	EUR	27.29		24 916
VESTAS WIND SYSTEMS	167	409.00	DKK	54.95		9 177
TDC A/S	4 420	40.01	DKK	5.38		23 761
ANHEUSER-BUSCH INB	676	91.14	EUR	91.14		61 611
OMV AG	278	51.86	EUR	51.86		14 417
ERST BK DER OEST.SPA	698	40.53	EUR	40.53		28 290
RAIFFEISEN INTL BK H	1 128	34.63	EUR	34.63		39 063
AIB GROUP PLC	3 763	5.62	EUR	5.62		21 129
ARCELOR MITTAL	808	29.23	EUR	29.23		23 614
						1 879 382
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					11	223 347
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	100.19%	EUR	100.19%	7	100 201
AGN Float 06/19	100 000	100.18%	EUR	100.18%	4	100 184
						200 385
Acções						
SUNRISE COM. GROUP	304	87.50	CHF	75.53		22 962
						11 812 393
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						3 691 226
CXG OBRIGAÇÕES	390 013	4.49	EUR	4.49		1 750 142
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.70	EUR	3.70		713 505
CXG PRIVATE EQUITY	21 147	5.95	EUR	5.95		125 916
CXG INFRAESTRUTURAS	33 755	6.79	EUR	6.79		229 169
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.34	EUR	5.34		602 327
F.I.IMOB.IMOSOCIAL	16 827	5.17	EUR	5.17		87 043
FUNDIESTAMO I	58	1 028.68	EUR	1 028.68		59 664
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.20	EUR	10.20		73 480
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	2.98	EUR	2.98		49 980
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						8 520 685
BROCK EURO MKT Fd D2	33 634	34.09	EUR	34.09		1 146 583
PIONEER EUROLND EQ I	116 943	9.71	EUR	9.71		1 135 517
BANTLEON OPPORTUNIT'	1 346	175.22	EUR	175.22		235 846
Natixis Tresorie I	28	12 534.90	EUR	12 534.90		350 977
Janus Hend H. Pan Al	1 764	16.77	EUR	16.77		29 582

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Schroder ISF Euro Eq	24 663	46.84	EUR	46.84		1 155 210
MERRILL LYNCH MARSH	469	145.00	EUR	145.00		68 005
JAN HND UK Abs Ret	9 278	7.23	EUR	7.23		67 097
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.69	EUR	1.69		44 873
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 344.78	EUR	1 344.78		51 102
SCH EUROP ALPHA ABS	431	110.85	EUR	110.85		47 774
LYXOR EPSILON GLOB E	281	133.44	EUR	133.44		37 498
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 851.67	EUR	1 851.67		1 157 294
Janus Hend Horiz Eur	74 465	15.22	EUR	15.22		1 133 357
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 035.90	EUR	1 035.90		116 021
DNCA INVEST-MIURA-I	181	132.19	EUR	132.19		23 926
AXA WF EUR SD-I-XC€	3 609	100.30	EUR	100.30		362 026
ISHARES STOXX EU 600	6 630	19.09	EUR	19.09		126 553
HYPO DJ ESTX 50 FRA	13 836	36.01	EUR	36.01		498 165
ISHARES S&P 500 MONT	11 479	63.88	EUR	63.88		733 279
						12 211 911

LIQUIDEZ

À vista						1 589 877
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			399
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			6 188
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 535 085
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 143
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			58
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			20 976
DO CGD - USD 0.0000%			USD			3 991
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			22 036
						1 589 877
						1 589 877

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos					44	19 301
Valores Passivos						-102 524
						-83 224
						25 530 957

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

TYH8-USD CBT 03/18	-6	121.47	USD	97.75		-586 475
--------------------	----	--------	-----	-------	--	----------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

4 024 629.08

Valor da Unidade de Participação: € 6.3437