

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-09-30

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.					3 203	329 867
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	313 000	97.77%	EUR	97.77%	3 203	309 223
Acções						
EDP Renováveis	2 362	8.74	EUR	8.74		20 644
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					191 375	63 866 301
Títulos de Dívida Pública						
DBR 5.5% 01/04/31	760 000	158.45%	EUR	158.45%	30 921	1 235 141
DBR 4% 04/01/37	130 000	153.81%	EUR	153.81%	3 847	203 794
DBR 3.25% 01/2020	1 900 000	104.94%	EUR	104.94%	45 678	2 039 481
DBR 3% 07/2020	998 000	106.31%	EUR	106.31%	7 300	1 068 224
DBR 2.5% 07/2044	600 000	133.56%	EUR	133.56%	3 658	805 042
DBR 1.5% 02/2023	1 100 000	107.51%	EUR	107.51%	10 307	1 192 895
DBR 1.5% 05/2023	481 000	107.76%	EUR	107.76%	2 748	521 059
DBR 1.75% 2/2024	455 000	109.72%	EUR	109.72%	4 974	504 177
BKO 0% 12/18	574 000	100.05%	EUR	100.05%		574 310
BKO 0% 03/19	450 000	100.26%	EUR	100.26%		451 184
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	159.38%	EUR	159.38%	6 547	538 877
FRTR 3% 04/2022	960 000	111.43%	EUR	111.43%	12 546	1 082 293
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	136.86%	EUR	136.86%	3 388	407 117
SPGB 4.6% 07/2019	1 013 000	104.08%	EUR	104.08%	8 043	1 062 404
SPGB 5.15% 10/2044	250 000	152.30%	EUR	152.30%	11 817	392 557
SPGB 3.45% 07/66	271 000	115.38%	EUR	115.38%	1 614	314 288
SPGB0.4% 04/22	290 000	100.70%	EUR	100.70%	489	292 508
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	100.52%	EUR	100.52%	5 051	1 234 411
BTPS 4% 2/2037	700 000	107.78%	EUR	107.78%	4 641	759 129
BTPS 5% 03/2025	714 000	113.53%	EUR	113.53%	2 959	813 541
BTPS 4.5% 03/2024	670 000	109.72%	EUR	109.72%	2 499	737 603
BTPS 2% 12/2025	900 000	94.88%	EUR	94.88%	6 000	859 875
						17 089 908
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	102.27%	EUR	102.27%	71	409 147
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	99.55%	EUR	99.55%	355	1 095 438
VW Float 07/19	200 000	100.07%	EUR	100.07%	14	200 148
VW Float 07/21	200 000	99.77%	EUR	99.77%	62	199 592
BASGR Float 11/19	200 000	100.27%	EUR	100.27%		200 548
SAPGR Float 03/21	300 000	100.43%	EUR	100.43%		301 293
VW Float 10/19	200 000	100.07%	EUR	100.07%	13	200 151
VW Float 12/21	200 000	100.40%	EUR	100.40%	44	200 840
ACAFP Float 04/22	900 000	100.51%	EUR	100.51%	874	905 428
MCFP Float 11/18	200 000	100.03%	EUR	100.03%		200 066
BNP Float 06/24	600 000	99.94%	EUR	99.94%	172	599 806

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.15%	EUR	100.15%	66	400 666
RENAULT Float 11/24	800 000	98.76%	EUR	98.76%	324	790 428
ALDFP Float 11/20	300 000	100.02%	EUR	100.02%	32	300 092
BNP Float 05/23	500 000	99.56%	EUR	99.56%	167	497 982
HSBC Float 09/22	350 000	100.51%	EUR	100.51%	15	351 800
SANUK Float 05/23	200 000	99.36%	EUR	99.36%	108	198 820
RBS Float 06/20	500 000	99.86%	EUR	99.86%	32	499 317
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	99.49%	EUR	99.49%	128	995 068
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	99.65%	EUR	99.65%	438	996 928
RBS Float 03/2020	200 000	99.86%	EUR	99.86%	13	199 725
IBESM Float 02/24	700 000	100.85%	EUR	100.85%	287	706 244
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.07%	EUR	101.07%	195	1 010 865
BBVASM Float 04/22	700 000	100.43%	EUR	100.43%	439	703 442
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	100.96%	EUR	100.96%	3 233	407 069
AMSSM Float 03/22	200 000	100.24%	EUR	100.24%	9	200 489
SCANIA Float 04/20	300 000	100.18%	EUR	100.18%	48	300 600
SRGIM Float 08/24	1 000 000	97.92%	EUR	97.92%	135	979 295
FCABNK Float 06/21	100 000	98.72%	EUR	98.72%	0	98 717
MS Float 01/22	300 000	100.37%	EUR	100.37%	208	301 327
BAC Float 02/22	200 000	100.79%	EUR	100.79%	147	201 729
BAC Float 05/23	450 000	100.57%	EUR	100.57%	323	452 883
GM Float 05/21	800 000	100.27%	EUR	100.27%	417	802 593
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.11%	EUR	100.11%		1 001 050
BATSLN Float 08/21	500 000	100.04%	EUR	100.04%	116	500 316
GS Float 09/23	300 000	99.28%	EUR	99.28%	13	297 838
T Float 09/2023	1 000 000	101.20%	EUR	101.20%	398	1 012 388
C Float 03/23	500 000	99.91%	EUR	99.91%	25	499 595
GM Float 03/22	300 000	99.52%	EUR	99.52%	10	298 567
BAC FLOAT 04/24	400 000	99.94%	EUR	99.94%	286	400 026
NDASS Float 09/21	400 000	100.84%	EUR	100.84%	8	403 384
UBS Float 04/2021	500 000	100.52%	EUR	100.52%	174	502 754
SCANIA Float 03/21	200 000	99.85%	EUR	99.85%	10	199 708
MYL FLOAT 11/18	500 000	100.09%	EUR	100.09%	306	500 761
VW Float 03/19	200 000	100.06%	EUR	100.06%	1	200 115
DAIGR Float 05/22	100 000	99.67%	EUR	99.67%		99 669
MYL Float 05/20	200 000	100.12%	EUR	100.12%	38	200 270
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.15%	EUR	100.15%	22	600 946
AEGON 0.375% 11/24	100 000	98.82%	EUR	98.82%	323	99 140
ALVGR Float 12/20	500 000	100.93%	EUR	100.93%	60	504 695
DAIGR Float 04/20	200 000	100.41%	EUR	100.41%	84	200 910
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.11%	EUR	100.11%	27	500 592
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.33%	EUR	100.33%	10	301 012
INTNED Float 09/23	300 000	100.15%	EUR	100.15%	49	300 493
NYKRE Float 06/22	700 000	99.90%	EUR	99.90%	137	699 430
JYBC Float 06/20	400 000	100.32%	EUR	100.32%	10	401 278
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.01%	EUR	100.01%	4	200 023
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.25%	EUR	100.25%	42	401 038

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
KBCBB Float 11/22	400 000	99.91%	EUR	99.91%	98	399 726
DLTAS 2008-1 A	625 745	99.50%	EUR	99.50%	22	622 669
DE Float 09/20	100 000	100.21%	EUR	100.21%		100 211
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.94%	EUR	99.94%	31	499 736
MIZUHO Float 04/23	500 000	100.13%	EUR	100.13%	206	500 861
NAB Float 04/2021	300 000	101.02%	EUR	101.02%	154	303 220
BMO Float 09/21	200 000	100.67%	EUR	100.67%	3	201 351
BMO Float 03/22	200 000	100.55%	EUR	100.55%	17	201 117
BCHINA Float 11/20	400 000	99.85%	EUR	99.85%	67	399 459
BNFP Float 01/2020	700 000	100.27%	EUR	100.27%	13	701 931
CAFP Float 03/2020	800 000	100.32%	EUR	100.32%	46	802 630
BFCM Float 03/2019	700 000	100.31%	EUR	100.31%	86	702 249
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.44%	EUR	100.44%	108	703 160
UPS Float 07/2020	200 000	100.59%	EUR	100.59%	47	201 231
DE Float 04/20	300 000	100.31%	EUR	100.31%	17	300 935
JPM Float 01/2020	300 000	100.58%	EUR	100.58%	126	301 869
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.32%	EUR	100.32%	204	602 118
MS Float 11/19	250 000	100.61%	EUR	100.61%	111	251 636
GS Float 07/2022	600 000	101.61%	EUR	101.61%	758	610 424
GS Float 29/05/2020	750 000	100.74%	EUR	100.74%	262	755 827
BAC Float 05/2019	600 000	100.60%	EUR	100.60%	1 065	604 635
C Float 11/2019	700 000	100.44%	EUR	100.44%	220	703 300
CS Float 10/2019	700 000	100.40%	EUR	100.40%	193	702 965
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.36%	EUR	100.36%		200 726
MMM Float 05/20	800 000	100.41%	EUR	100.41%		803 304
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.30%	EUR	100.30%	29	802 389
POHBK Float 03/20	500 000	100.29%	EUR	100.29%		501 470
RY Float 03/2019	300 000	100.19%	EUR	100.19%	4	300 577
SKYLN Float 04/20	300 000	100.72%	EUR	100.72%	323	302 492
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.29%	EUR	100.29%		501 435
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.40%	EUR	100.40%		301 200
FDX Float 04/19	300 000	100.22%	EUR	100.22%	156	300 822
ISPIM Float 04/2019	500 000	100.16%	EUR	100.16%	770	501 590
ISPIM Float 06/20	800 000	100.02%	EUR	100.02%	227	800 355
GE Float 01/2020	1 000 000	100.23%	EUR	100.23%	115	1 002 395
GIS Float 01/2020	400 000	100.77%	EUR	100.77%	350	403 422
MCD Float 08/2019	300 000	100.20%	EUR	100.20%		300 594
						44 021 417
Acções						
SIEMENS	895	110.34	EUR	110.34		98 754
ALLIANZ	102	192.00	EUR	192.00		19 584
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	8.78	EUR	8.78		13 644
BASF	587	76.55	EUR	76.55		44 935
BAYER AG	579	76.51	EUR	76.51		44 299
ADIDAS- SALOMON AG	222	210.90	EUR	210.90		46 820
SAP SE	392	106.00	EUR	106.00		41 552

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DEUTSCHE TELEKOM	1 833	13.89	EUR	13.89		25 451
DAIMLER CHRYSLER	377	54.35	EUR	54.35		20 490
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	19.57	EUR	19.57		38 651
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	151.60	EUR	151.60		74 284
LEONI AG	987	35.45	EUR	35.45		34 989
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	63.24	EUR	63.24		44 394
COVESTRO AG	187	69.86	EUR	69.86		13 064
VONOVIA SE	1	42.08	EUR	42.08		42
DANONE	747	66.70	EUR	66.70		49 825
PERNOD RICARD	90	141.30	EUR	141.30		12 717
TOTAL SA	2 134	55.84	EUR	55.84		119 163
Kering	107	461.70	EUR	461.70		49 402
PEUGEOT CITROEN	2 447	23.23	EUR	23.23		56 844
BNP	204	52.71	EUR	52.71		10 753
AIR LIQUIDE	250	113.30	EUR	113.30		28 325
SCHNEIDER	213	69.30	EUR	69.30		14 761
L.V.M.H.	298	304.60	EUR	304.60		90 771
ORANGE	3 300	13.74	EUR	13.74		45 326
GLE ENTREP. VINCI	245	82.02	EUR	82.02		20 095
SANOFI SYNHLABO	311	76.56	EUR	76.56		23 810
AIRBUS SE	623	108.18	EUR	108.18		67 396
ARKEMA	117	106.70	EUR	106.70		12 484
SAFRAN SA	505	120.70	EUR	120.70		60 954
3I GROUP	2 384	9.41	GBP	10.57		25 199
RECKITT BENCKISER	219	70.16	GBP	78.79		17 256
WEIR GROUP PLC	971	17.63	GBP	19.80		19 225
OCADO GROUP PLC	2 109	8.99	GBP	10.10		21 298
ADMIRAL GROUP PLC	2 085	20.80	GBP	23.36		48 705
ASHTED GROUP PLC	842	24.37	GBP	27.37		23 045
SHIRE PLC	753	46.24	GBP	51.92		39 099
AMADEUS HOLDING SA	565	80.02	EUR	80.02		45 211
ROYAL DUTCH SHELL B	615	26.89	GBP	30.20		18 572
ROTORK PLC	5 663	3.31	GBP	3.71		21 019
TELEFONICA	5 042	6.82	EUR	6.82		34 376
BCO SANTANDER C.HISP	20 080	4.34	EUR	4.34		87 057
IBERDROLA	3 831	6.34	EUR	6.34		24 281
MASMOVIL IBERCOM	169	99.40	EUR	99.40		16 799
UNICREDITO ITALIANO	2 396	12.96	EUR	12.96		31 062
ENI SPA	722	16.28	EUR	16.28		11 756
BANCA INTESA	11 322	2.20	EUR	2.20		24 920
ENEL	4 661	4.41	EUR	4.41		20 564
ESSITY AKTIEBO-B	619	223.40	SEK	21.65		13 399
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	19.75	EUR	19.75		10 626
ING GROEP NV	5 284	11.18	EUR	11.18		59 096
UNILEVER NV-CVA	1 685	47.97	EUR	47.97		80 821
ASML NA	432	160.90	EUR	160.90		69 509
AKZO NOBEL NV NLG20	227	80.54	EUR	80.54		18 283

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ABN AMRO GROUP NV	2 296	23.45	EUR	23.45		53 841
ASR NEDERLAND NV	1 275	41.06	EUR	41.06		52 352
EURONEXT NV	441	56.65	EUR	56.65		24 983
VESTAS WIND SYSTEMS	230	434.40	DKK	58.25		13 398
ANHEUSER-BUSCH INB	960	75.22	EUR	75.22		72 211
ERST BK DER OEST.SPA	949	35.78	EUR	35.78		33 955
RAIFFEISEN INTL BK H	1 681	24.80	EUR	24.80		41 689
TENARIS SA	1 683	14.43	EUR	14.43		24 286
ARCELOR MITTAL	909	26.80	EUR	26.80		24 361
						2 345 829
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					111	1 894 310
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.12%	EUR	100.12%		300 348
F Float 12/21	500 000	97.95%	EUR	97.95%	19	489 779
UBS Float 09/22	700 000	100.47%	EUR	100.47%	81	703 336
AGN Float 06/19	300 000	100.09%	EUR	100.09%	7	300 265
SUMIBK Float 09/20	100 000	100.58%	EUR	100.58%	3	100 581
						1 894 310
						66 090 477
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						14 254 234
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.45	EUR	4.45		9 792 687
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.86	EUR	3.86		2 890 281
CXG PRIVATE EQUITY	40 509	5.48	EUR	5.48		221 985
CXG INFRAESTRUTURAS	94 830	7.21	EUR	7.21		683 629
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.33	EUR	5.33		665 651
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						21 399 057
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	32.57	EUR	32.57		1 833 756
Amundi Funds II-Eur	195 755	9.47	EUR	9.47		1 853 800
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.53	EUR	16.53		146 489
Schroder ISF Euro Eq	41 285	45.30	EUR	45.30		1 870 297
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	146.04	EUR	146.04		347 575
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.20	EUR	7.20		338 570
Merian Global Invest	134 786	1.64	EUR	1.64		221 521
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 351.53	EUR	1 351.53		263 548
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	104.22	EUR	104.22		227 409
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	123.70	EUR	123.70		176 028
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 828.15	EUR	1 828.15		1 912 245
Janus Hend Horiz Eur	124 650	14.54	EUR	14.54		1 812 411
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 026.52	EUR	1 026.52		589 222
DNCA INVEST-MIURA-I	917	123.05	EUR	123.05		112 837
MS EUROCORP BD-Z	129 701	29.40	EUR	29.40		3 813 209
HYPO DJ ESTX 50 FRA	75 052	34.01	EUR	34.01		2 552 519
ISHARES S&P 500 MONT	50 815	65.49	EUR	65.49		3 327 620
OIC domici. em Estados não membros da EU						25 003

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TISHMAN ESOF	91 579	0.27	EUR	0.27		25 003
						35 678 293

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						1 144 000
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			274
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			219
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			955 660
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 660
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			104
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			28
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			188
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			185 848
						1 144 000
						1 144 000

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						17 309
Valores Passivos						-342 108
						-324 799
						110 094 372

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

Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYZ8 USD CBT 12/18	-15	118.86	USD	102.27		-1 534 065

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 8 182 562.29

Valor da Unidade de Participação: € 13.4548