

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR  
Composição da Carteira em 2018-06-30

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.					766	143 407
Titulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	86 000	99.21%	EUR	99.21%	392	85 711
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	103.30%	EUR	103.30%	373	41 693
Acções						
EDP Renováveis	1 792	8.93	EUR	8.93		16 003
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						78 009
Titulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	78 000	100.01%	EUR	100.01%		78 009
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					62 317	11 842 862
Titulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	230 000	135.83%	EUR	135.83%	7 010	319 424
DBR 5.5% 01/04/31	140 000	161.48%	EUR	161.48%	3 755	229 830
DBR 4% 04/01/37	300 000	156.44%	EUR	156.44%	5 852	475 157
DBR 3.25% 01/2020	790 000	106.01%	EUR	106.01%	12 521	849 968
DBR 2.5% 07/2044	197 000	135.87%	EUR	135.87%	4 885	272 543
DBR 1.5% 02/2023	45 000	108.68%	EUR	108.68%	252	49 158
DBR 1.75% 2/2024	130 000	111.04%	EUR	111.04%	848	145 196
BKO 0% 09/18	500 000	100.04%	EUR	100.04%		500 190
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	163.20%	EUR	163.20%	1 074	213 227
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	140.38%	EUR	140.38%	99	42 212
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	123.48%	EUR	123.48%	2 085	131 735
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	105.40%	EUR	105.40%	8 046	208 298
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	144.06%	EUR	144.06%	2 163	74 193
SPGB 3.45% 07/66	51 000	117.53%	EUR	117.53%	1 620	61 558
SPGB 0.45% 10/22	286 000	101.07%	EUR	101.07%	857	289 906
BTPS 4% 2/2037	170 000	112.52%	EUR	112.52%	2 818	194 098
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	114.06%	EUR	114.06%	1 575	92 824
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	104.36%	EUR	104.36%	70	5 288
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	112.45%	EUR	112.45%	806	122 247
BTPS 4.5% 03/2024	90 000	112.89%	EUR	112.89%	1 343	102 944
SPGB 6% 31/01/2029	80 000	145.26%	EUR	145.26%	1 986	118 193
						4 498 189
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	102.51%	EUR	102.51%	8	51 264
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	100 000	99.08%	EUR	99.08%	30	99 107
BASGR Float 11/19	100 000	100.30%	EUR	100.30%		100 300
SAPGR Float 03/21	100 000	100.45%	EUR	100.45%		100 454
ACAFP Float 04/22	100 000	100.31%	EUR	100.31%	94	100 404
MCFP Float 11/18	60 000	100.08%	EUR	100.08%		60 049

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BNP Float 06/24	100 000	99.25%	EUR	99.25%	29	99 280
RENAUL Float 03/2022	100 000	99.85%	EUR	99.85%	16	99 868
RENAULT Float 11/24	50 000	98.23%	EUR	98.23%	19	49 136
ALDFP Float 11/20	100 000	100.02%	EUR	100.02%	10	100 033
HSBC Float 09/22	100 000	100.38%	EUR	100.38%	4	100 383
LLOYDS Float 06/2024	100 000	99.29%	EUR	99.29%	13	99 304
HSBC 0.17% 10/23	100 000	99.29%	EUR	99.29%	42	99 335
SANTAN Float 03/22	100 000	100.90%	EUR	100.90%	19	100 917
BKTSM 1.25% 02/28	200 000	101.57%	EUR	101.57%	986	204 122
SCANIA Float 04/20	100 000	100.20%	EUR	100.20%	14	100 215
BAC Float 05/23	100 000	100.26%	EUR	100.26%	73	100 330
MS Float 11/22	100 000	100.12%	EUR	100.12%	56	100 172
GM Float 05/21	100 000	100.48%	EUR	100.48%	51	100 528
T Float 09/2023	100 000	101.10%	EUR	101.10%	40	101 141
MS Float 05/21	100 000	99.82%	EUR	99.82%	8	99 829
NDASS Float 09/21	100 000	100.78%	EUR	100.78%	2	100 779
MYL FLOAT 11/18	100 000	100.23%	EUR	100.23%	60	100 292
VW Float 03/19	100 000	100.07%	EUR	100.07%	0	100 074
ALVGR Float 12/20	200 000	100.94%	EUR	100.94%	24	201 900
DAIGR Float 04/20	100 000	100.45%	EUR	100.45%	39	100 488
NYKRE Float 06/22	100 000	100.05%	EUR	100.05%	19	100 073
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.28%	EUR	100.28%	11	100 292
CCBGBB Float 09/2018	100 000	100.10%	EUR	100.10%	11	100 111
KBCBB Float 11/22	100 000	99.48%	EUR	99.48%	24	99 502
DLTAS 2008-1 A	73 124	99.61%	EUR	99.61%	3	72 841
SUMIBK Float 06/22	100 000	99.65%	EUR	99.65%	6	99 659
MIZUHO Float 04/23	100 000	99.75%	EUR	99.75%	39	99 787
BCHINA Float 11/20	100 000	99.92%	EUR	99.92%	16	99 932
CAFP Float 03/2020	100 000	100.35%	EUR	100.35%	6	100 355
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.47%	EUR	100.47%	21	100 494
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.47%	EUR	100.47%	14	100 484
UPS Float 07/2020	100 000	100.57%	EUR	100.57%	21	100 593
DE Float 04/20	100 000	100.35%	EUR	100.35%	4	100 350
GS Float 07/2022	75 000	101.41%	EUR	101.41%	92	76 147
GS Float 29/05/2020	125 000	100.68%	EUR	100.68%	43	125 898
BAC Float 05/2019	100 000	100.83%	EUR	100.83%	176	101 008
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.42%	EUR	100.42%		65 275
MMM Float 05/20	100 000	100.45%	EUR	100.45%		100 452
ANNGR Float 09/18	100 000	100.02%	EUR	100.02%	3	100 021
ARRFP Float 01/2020	100 000	100.74%	EUR	100.74%	92	100 836
POHBK Float 03/20	100 000	100.30%	EUR	100.30%		100 298
SKYLN Float 04/20	100 000	100.74%	EUR	100.74%	104	100 843
VOD Float 02/2019	100 000	100.52%	EUR	100.52%	64	100 583
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.40%	EUR	100.40%		150 603
ISPIM Float 04/2019	100 000	100.09%	EUR	100.09%	150	100 238
GE Float 01/2020	100 000	100.21%	EUR	100.21%	10	100 224
GIS Float 01/2020	100 000	100.85%	EUR	100.85%	85	100 933

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BMW Float 03/2019	100 000	100.18%	EUR	100.18%	2	100 179
MCD Float 08/2019	100 000	100.23%	EUR	100.23%		100 233
						5 516 686
Acções						
SIEMENS	499	113.22	EUR	113.22		56 497
ALLIANZ	77	177.02	EUR	177.02		13 631
E.ON AG(EX VEBAG)	1 179	9.15	EUR	9.15		10 793
BASF	414	81.91	EUR	81.91		33 911
BAYER AG	439	94.35	EUR	94.35		41 420
ADIDAS- SALOMON AG	127	186.95	EUR	186.95		23 743
SAP SE	297	98.95	EUR	98.95		29 388
LUFTHANSA	817	20.60	EUR	20.60		16 830
DEUTSCHE TELEKOM	1 390	13.27	EUR	13.27		18 445
DAIMLER CHRYSLER	286	55.13	EUR	55.13		15 767
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	21.83	EUR	21.83		32 308
DEUTSCHE POST	311	27.97	EUR	27.97		8 699
PUMA AG	8	501.00	EUR	501.00		4 008
VOLKSWAGEN AG-PREF.	372	142.22	EUR	142.22		52 906
LEONI AG	749	43.50	EUR	43.50		32 582
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	68.80	EUR	68.80		36 808
COVESTRO AG	177	76.42	EUR	76.42		13 526
DANONE	567	62.87	EUR	62.87		35 647
PERNOD RICARD	70	139.90	EUR	139.90		9 793
TOTAL SA	1 607	52.21	EUR	52.21		83 901
Kering	99	483.60	EUR	483.60		47 876
PEUGEOT CITROEN	1 928	19.56	EUR	19.56		37 712
BNP	154	53.19	EUR	53.19		8 191
AIR LIQUIDE	209	107.70	EUR	107.70		22 509
SCHNEIDER	290	71.42	EUR	71.42		20 712
L.V.M.H.	178	285.20	EUR	285.20		50 766
ACCOR	311	42.02	EUR	42.02		13 068
ORANGE	2 372	14.35	EUR	14.35		34 026
GLE ENTREP. VINCI	254	82.36	EUR	82.36		20 919
SANOFI SYNHLABO	243	68.65	EUR	68.65		16 682
AIRBUS SE	456	100.26	EUR	100.26		45 719
ARKEMA	96	101.40	EUR	101.40		9 734
3I GROUP	1 808	9.01	GBP	10.18		18 401
RECKITT BENCKISER	168	62.39	GBP	70.51		11 845
WEIR GROUP PLC	736	20.00	GBP	22.60		16 635
OCADO GROUP PLC	1 605	10.28	GBP	11.61		18 636
ADMIRAL GROUP PLC	1 581	19.08	GBP	21.56		34 080
ASHTED GROUP PLC	638	22.73	GBP	25.69		16 388
SHIRE PLC	571	42.65	GBP	48.20		27 521
AMADEUS HOLDING SA	429	67.60	EUR	67.60		29 000
ROYAL DUTCH SHELL B	492	27.14	GBP	30.66		15 087
ROTORK PLC	4 294	3.35	GBP	3.78		16 241

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TELEFONICA	3 826	7.28	EUR	7.28		27 849
BCO SANTANDER C.HISP	15 226	4.59	EUR	4.59		69 918
IBERDROLA	2 906	6.62	EUR	6.62		19 249
MASMOVIL IBERCOM	128	99.60	EUR	99.60		12 749
UNICREDITO ITALIANO	1 817	14.30	EUR	14.30		25 976
BANCA INTESA	8 591	2.49	EUR	2.49		21 362
ENEL	3 536	4.76	EUR	4.76		16 821
ESSITY AKTIEBO-B	469	221.20	SEK	21.16		9 923
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	20.51	EUR	20.51		8 366
ING GROEP NV	4 007	12.33	EUR	12.33		49 398
UNILEVER NV-CVA	1 274	47.79	EUR	47.79		60 878
ASML NA	327	169.70	EUR	169.70		55 492
AKZO NOBEL NV NLG20	173	73.32	EUR	73.32		12 684
ABN AMRO GROUP NV	1 741	22.22	EUR	22.22		38 685
ASR NEDERLAND NV	967	34.98	EUR	34.98		33 826
EURONEXT NV	335	54.45	EUR	54.45		18 241
VESTAS WIND SYSTEMS	167	395.00	DKK	53.01		8 853
ANHEUSER-BUSCH INB	728	86.50	EUR	86.50		62 972
BPOST SA	1 215	13.53	EUR	13.53		16 439
OMV AG	187	48.57	EUR	48.57		9 083
ERST BK DER OEST.SPA	698	35.75	EUR	35.75		24 954
RAIFFEISEN INTL BK H	1 276	26.29	EUR	26.29		33 546
TENARIS SA	1 310	15.72	EUR	15.72		20 587
ARCELOR MITTAL	658	25.11	EUR	25.11		16 522
						1 776 724
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					20	298 960
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	99.20%	EUR	99.20%	4	99 200
F Float 05/21	100 000	99.67%	EUR	99.67%	13	99 686
AGN Float 06/19	100 000	100.07%	EUR	100.07%	2	100 073
						298 960
						12 363 239

## UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						3 657 827
CXG OBRIGAÇÕES	390 013	4.45	EUR	4.45		1 734 620
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.82	EUR	3.82		735 118
CXG PRIVATE EQUITY	16 936	5.62	EUR	5.62		95 219
CXG INFRAESTRUTURAS	34 705	6.77	EUR	6.77		234 953
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.33	EUR	5.33		600 333
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	5.27	EUR	5.27		88 717
FUNDIESTAMO I	58	1 054.72	EUR	1 054.72		61 174
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.28	EUR	10.28		74 087
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	2.00	EUR	2.00		33 606
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						8 029 401
BROCK EURO MKT Fd D2	35 038	32.02	EUR	32.02		1 121 917

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Amundi Funds II-Eur	121 886	9.38	EUR	9.38		1 143 291
Janus Hend H. Pan Al	1 764	16.73	EUR	16.73		29 512
Schroder ISF Euro Eq	25 669	44.30	EUR	44.30		1 137 047
MERRILL LYNCH MARSH	469	144.32	EUR	144.32		67 686
JAN HND UK Abs Ret	9 278	7.23	EUR	7.23		67 046
OLD MUTUAL GLOB EQ	26 555	1.67	EUR	1.67		44 265
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 362.13	EUR	1 362.13		51 761
SCH EUROP ALPHA ABS	431	104.35	EUR	104.35		44 976
LYXOR EPSILON GLOB E	281	128.39	EUR	128.39		36 078
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 834.65	EUR	1 834.65		1 146 656
Janus Hend Horiz Eur	77 610	14.35	EUR	14.35		1 113 704
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 024.26	EUR	1 024.26		114 717
DNCA INVEST-MIURA-I	181	125.89	EUR	125.89		22 786
HYPO DJ ESTX 50 FRA	24 779	34.49	EUR	34.49		854 504
ISHARES S&P 500 MONT	16 766	61.64	EUR	61.64		1 033 456
						11 687 228

### LIQUIDEZ

À vista						853 382
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			402
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			159
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			443 257
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			32 571
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			58
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			284
DO CGD - USD 0.0000%			USD			349 674
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			26 975
						853 382
						853 382

### OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						28 485
Valores Passivos						-446 405
						-417 919
						24 485 929

### VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

### RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

### OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

TYU8 USD CBT 09/18	-5	120.22	USD	102.94		-514 679
--------------------	----	--------	-----	--------	--	----------

### NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

3 942 040.26

Valor da Unidade de Participação: € 6.2115