

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

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.					17 454	1 629 830
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	1 300 000	122.75%	EUR	122.75%	17 454	1 613 178
Acções						
EDP Renováveis	2 362	7.05	EUR	7.05		16 652
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						407 794
Títulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	407 000	100.20%	EUR	100.20%		407 794
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					138 706	56 331 093
Títulos de Dívida Pública						
DBR 4% 04/01/37	100 000	150.11%	EUR	150.11%	307	150 413
DBR 3% 07/2020	98 000	108.39%	EUR	108.39%	1 708	107 926
DBR 2.5% 07/2044	470 000	127.79%	EUR	127.79%	6 825	607 442
DBR 1.5% 05/2023	481 000	107.39%	EUR	107.39%	5 179	521 730
OBL 0.5% 02/2018	612 000	100.00%	EUR	100.00%	2 876	614 869
BKO 0% 09/18	3 700 000	100.33%	EUR	100.33%		3 712 062
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	157.84%	EUR	157.84%	11 612	538 794
FRTR 3% 04/2022	960 000	112.64%	EUR	112.64%	22 251	1 103 624
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	134.23%	EUR	134.23%	6 619	402 604
SPGB 4.6% 07/2019	805 000	107.38%	EUR	107.38%	18 870	883 311
SPGB 0.25% 04/2018	218 000	100.13%	EUR	100.13%	414	218 686
SPGB 3.45% 07/66	271 000	115.53%	EUR	115.53%	4 764	317 845
SPGB0.4% 04/22	290 000	100.50%	EUR	100.50%	880	292 316
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	100.26%	EUR	100.26%	1 402	1 227 521
BTPS 4.75% 08/2023	305 000	119.96%	EUR	119.96%	7 244	373 116
BTPS 5% 03/2025	514 000	123.34%	EUR	123.34%	10 862	644 840
BTPS 4.5% 05/2023	254 000	118.05%	EUR	118.05%	2 905	302 757
BTPS 4.5% 03/2024	400 000	118.99%	EUR	118.99%	7 608	483 556
BTPS 3.5% 03/2030	700 000	111.88%	EUR	111.88%	10 355	793 480
						13 296 892
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	100.92%	EUR	100.92%	107	1 110 271
VW Float 07/19	100 000	100.27%	EUR	100.27%	1	100 266
VW Float 07/21	200 000	100.43%	EUR	100.43%	16	200 874
ACAFP Float 04/22	700 000	102.22%	EUR	102.22%	92	715 632
MCFP Float 11/18	200 000	100.23%	EUR	100.23%		200 466
BNP Float 06/24	600 000	102.41%	EUR	102.41%	396	614 838
RENAUL Float 03/2022	400 000	101.42%	EUR	101.42%	187	405 863
RENAULT Float 11/24	800 000	100.89%	EUR	100.89%	483	807 595
ALDFP Float 11/20	300 000	100.53%	EUR	100.53%	56	301 643
HSBC Float 09/22	350 000	101.54%	EUR	101.54%	130	355 502
RBS Float 06/20	500 000	100.62%	EUR	100.62%	79	503 174

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	102.35%	EUR	102.35%	526	1 024 026
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	100.76%	EUR	100.76%	128	1 007 718
IBESM Float 02/24	700 000	101.02%	EUR	101.02%	484	707 610
SANTAN Float 03/22	1 000 000	102.56%	EUR	102.56%	806	1 026 416
BBVASM Float 04/22	1 000 000	101.35%	EUR	101.35%	151	1 013 681
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	99.90%	EUR	99.90%		399 600
SCANIA Float 10/18	100 000	100.18%	EUR	100.18%	0	100 182
SCANIA Float 04/20	300 000	100.43%	EUR	100.43%	6	301 284
SRGIM Float 08/24	1 000 000	100.43%	EUR	100.43%	174	1 004 424
MS Float 01/22	300 000	101.20%	EUR	101.20%	9	303 609
BAC Float 02/22	200 000	101.57%	EUR	101.57%	225	203 367
BAC Float 05/23	450 000	101.85%	EUR	101.85%	490	458 824
GM Float 05/21	800 000	101.03%	EUR	101.03%	647	808 871
T Float 09/2023	1 000 000	102.42%	EUR	102.42%	859	1 025 069
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.28%	EUR	100.28%		1 002 800
BATSLN Float 08/21	500 000	100.80%	EUR	100.80%	183	504 203
GS Float 09/23	300 000	100.73%	EUR	100.73%	87	302 286
NDASS Float 09/21	200 000	101.47%	EUR	101.47%	34	202 970
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.47%	EUR	100.47%	854	804 582
VW Float 03/19	200 000	100.25%	EUR	100.25%	4	200 494
MYL Float 05/20	200 000	100.25%	EUR	100.25%	66	200 574
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.44%	EUR	100.44%	26	602 642
AEGON 0.375% 11/24	100 000	98.02%	EUR	98.02%	148	98 163
ALVGR Float 12/20	500 000	101.35%	EUR	101.35%	138	506 893
SYDBDC Float 05/18	400 000	100.12%	EUR	100.12%	174	400 666
NYKRE Float 06/22	700 000	100.91%	EUR	100.91%	276	706 667
JYBC Float 06/20	400 000	100.46%	EUR	100.46%	14	401 846
KBCBB Float 11/22	400 000	101.30%	EUR	101.30%	169	405 349
DLTAS 2008-1 A	712 079	99.94%	EUR	99.94%	36	711 716
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.64%	EUR	100.64%	84	503 284
NAB Float 04/2021	300 000	101.55%	EUR	101.55%	26	304 664
BMO Float 09/21	200 000	101.25%	EUR	101.25%	33	202 539
BCHINA Float 11/20	400 000	100.28%	EUR	100.28%	111	401 239
BNFP Float 01/2020	700 000	100.46%	EUR	100.46%	0	703 185
CAFP Float 03/2020	800 000	100.74%	EUR	100.74%	179	806 123
BFCM Float 03/2019	700 000	100.81%	EUR	100.81%	327	705 969
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.69%	EUR	100.69%	14	704 865
DE Float 04/20	300 000	100.51%	EUR	100.51%	2	301 517
JPM Float 01/2020	300 000	101.06%	EUR	101.06%	6	303 174
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.78%	EUR	100.78%	350	605 030
MS Float 11/19	250 000	101.12%	EUR	101.12%	188	252 986
GS Float 07/2022	600 000	102.85%	EUR	102.85%	67	617 149
GS Float 29/05/2020	550 000	101.12%	EUR	101.12%	363	556 517
BAC Float 03/2018	300 000	100.06%	EUR	100.06%	149	300 323
BAC Float 05/2019	600 000	101.44%	EUR	101.44%	1 640	610 268
C Float 11/2019	700 000	100.84%	EUR	100.84%	344	706 231
CS Float 10/2019	700 000	100.74%	EUR	100.74%	38	705 197

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.67%	EUR	100.67%		201 348
MMM Float 05/20	600 000	100.58%	EUR	100.58%		603 474
ANNGR Float 09/18	200 000	100.15%	EUR	100.15%	15	200 311
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.75%	EUR	100.75%	318	806 326
UNANA Float 06/18	500 000	100.11%	EUR	100.11%		500 530
POHBK Float 03/20	500 000	100.57%	EUR	100.57%		502 860
RY Float 03/2019	300 000	100.51%	EUR	100.51%	36	301 557
SKYLN Float 04/20	300 000	101.22%	EUR	101.22%	105	303 762
ENELIM Float 02/2018	150 000	100.15%	EUR	100.15%	1 933	152 163
CAT Float 05/2018	500 000	100.06%	EUR	100.06%		500 300
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.59%	EUR	100.59%		502 970
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.74%	EUR	100.74%		302 214
FDX Float 04/19	300 000	100.51%	EUR	100.51%	39	301 554
CAPFP Float 07/2018	300 000	100.13%	EUR	100.13%	130	300 526
VW Float 07/2018	200 000	100.11%	EUR	100.11%		200 216
F Float 02/2018	800 000	100.01%	EUR	100.01%	260	800 324
ISPIM Float 04/2019	500 000	101.08%	EUR	101.08%	150	505 545
ISPIM Float 06/20	800 000	101.94%	EUR	101.94%	769	816 297
GE Float 01/2020	1 000 000	100.49%	EUR	100.49%	14	1 004 934
GIS Float 01/2020	400 000	101.19%	EUR	101.19%	71	404 847
MCD Float 08/2019	300 000	100.38%	EUR	100.38%		301 149
						40 556 127
<b>Acções</b>						
SIEMENS	314	122.16	EUR	122.16		38 358
ALLIANZ	102	203.50	EUR	203.50		20 757
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	8.46	EUR	8.46		13 145
BASF	531	94.32	EUR	94.32		50 084
BAYER AG	531	105.42	EUR	105.42		55 978
ADIDAS- SALOMON AG	260	187.30	EUR	187.30		48 698
SAP SE	392	90.83	EUR	90.83		35 605
LUFTHANSA	1 104	28.74	EUR	28.74		31 729
DEUTSCHE TELEKOM	1 294	14.13	EUR	14.13		18 278
DAIMLER CHRYSLER	930	73.73	EUR	73.73		68 569
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	23.41	EUR	23.41		46 235
DEUTSCHE POST	1 302	38.07	EUR	38.07		49 567
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	177.02	EUR	177.02		86 740
RHEINMETALL AG	405	113.90	EUR	113.90		46 130
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	70.48	EUR	70.48		49 477
1&1 Drillisch	578	67.00	EUR	67.00		38 726
COVESTRO AG	187	92.58	EUR	92.58		17 312
VONOVIA SE	307	39.71	EUR	39.71		12 191
DANONE	858	69.46	EUR	69.46		59 597
TOTAL SA	1 384	46.64	EUR	46.64		64 543
Kering	97	407.80	EUR	407.80		39 557
BNP	204	66.60	EUR	66.60		13 586
AIR LIQUIDE	250	108.55	EUR	108.55		27 138
SCHNEIDER	767	75.48	EUR	75.48		57 893

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
L.V.M.H.	284	252.60	EUR	252.60		71 738
ACCOR	420	45.85	EUR	45.85		19 257
BOUYGUES	596	44.77	EUR	44.77		26 683
GLE ENTREP. VINCI	672	87.00	EUR	87.00		58 464
SANOFI SYNHLABO	311	71.12	EUR	71.12		22 118
LEGRAND PROMESSES	305	67.02	EUR	67.02		20 441
ARKEMA	117	102.90	EUR	102.90		12 039
SAFRAN SA	323	90.94	EUR	90.94		29 374
ELIS SA	1 124	22.50	EUR	22.50		25 290
HSBC HOLDINGS	4 222	7.51	GBP	8.57		36 195
DIAGEO ORD.	461	25.33	GBP	28.91		13 325
3I GROUP	4 075	9.31	GBP	10.63		43 321
Imperial Brands PLC	392	28.99	GBP	33.08		12 969
RECKITT BENCKISER	219	68.03	GBP	77.65		17 005
OCADO GROUP PLC	2 109	5.04	GBP	5.75		12 123
SHIRE PLC	753	33.28	GBP	37.98		28 599
AMADEUS HOLDING SA	640	62.48	EUR	62.48		39 987
ROYAL DUTCH SHELL B	620	24.96	GBP	28.49		17 663
TELEFONICA	1 706	8.25	EUR	8.25		14 080
BCO SANTANDER C.HISP	15 885	5.98	EUR	5.98		95 040
IBERDROLA	3 831	6.56	EUR	6.56		25 124
REPSOL	985	15.16	EUR	15.16		14 928
INDITEX	453	28.87	EUR	28.87		13 078
MEDIOBANCA	4 235	9.79	EUR	9.79		41 469
BANCA INTESA	12 563	3.16	EUR	3.16		39 705
ENEL	5 499	5.11	EUR	5.11		28 100
FINECOBANK SPA	3 936	10.01	EUR	10.01		39 399
CATTOLICA ASSIC	5 279	10.03	EUR	10.03		52 948
ESSITY AKTIEBO-B	619	236.00	SEK	24.11		14 924
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	17.97	EUR	17.97		9 668
ING GROEP NV	5 962	15.83	EUR	15.83		94 378
UNILEVER NV-CVA	1 602	46.65	EUR	46.65		74 733
ASML NA	521	163.20	EUR	163.20		85 027
AKZO NOBEL NV NLG20	227	75.42	EUR	75.42		17 120
ABN AMRO GROUP NV	1 204	27.29	EUR	27.29		32 857
VESTAS WIND SYSTEMS	220	409.00	DKK	54.95		12 090
TDC A/S	5 828	40.01	DKK	5.38		31 330
ANHEUSER-BUSCH INB	891	91.14	EUR	91.14		81 206
OMV AG	366	51.86	EUR	51.86		18 981
ERST BK DER OEST.SPA	949	40.53	EUR	40.53		38 463
RAIFFEISEN INTL BK H	1 516	34.63	EUR	34.63		52 499
AIB GROUP PLC	4 965	5.62	EUR	5.62		27 878
ARCELOR MITTAL	909	29.23	EUR	29.23		26 566
						2 478 074
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					356	1 843 828
Obrigações diversas						

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
KO Float 03/19	300 000	100.36%	EUR	100.36%		301 068
F Float 12/21	500 000	100.19%	EUR	100.19%	35	501 005
UBS Float 09/22	700 000	101.52%	EUR	101.52%	310	710 915
AGN Float 06/19	300 000	100.18%	EUR	100.18%	11	300 551
						1 813 539
Acções						
SUNRISE COM. GROUP	401	87.50	CHF	75.53		30 289
						60 212 545

### UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						14 410 606
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.49	EUR	4.49		9 874 102
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.70	EUR	3.70		2 776 133
CXG PRIVATE EQUITY	50 512	5.95	EUR	5.95		300 764
CXG INFRAESTRUTURAS	116 657	6.79	EUR	6.79		792 008
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.34	EUR	5.34		667 599
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						29 365 897
MS EUROCORP DURHED Z	180 722	30.31	EUR	30.31		5 477 684
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	34.09	EUR	34.09		1 919 335
PIONEER EUROLND EQ I	195 755	9.71	EUR	9.71		1 900 781
BANTLEON OPPORTUNIT	6 378	175.22	EUR	175.22		1 117 553
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.77	EUR	16.77		148 616
Schroder ISF Euro Eq	41 285	46.84	EUR	46.84		1 933 781
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	145.00	EUR	145.00		345 100
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.23	EUR	7.23		340 263
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.69	EUR	1.69		227 761
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 344.78	EUR	1 344.78		262 232
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	110.85	EUR	110.85		241 864
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	133.44	EUR	133.44		189 892
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 851.67	EUR	1 851.67		1 936 847
Janus Hend Horiz Eur	124 650	15.22	EUR	15.22		1 897 173
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 035.90	EUR	1 035.90		594 607
DNCA INVEST-MIURA-I	917	132.19	EUR	132.19		121 218
AXA WF EUR SD-I-XC€	42 529	100.30	EUR	100.30		4 265 624
ISHARES STOXX EU 600	31 470	19.09	EUR	19.09		600 699
HYPO DJ ESTX 50 FRA	65 673	36.01	EUR	36.01		2 364 556
ISHARES S&P 500 MONT	54 482	63.88	EUR	63.88		3 480 310
OIC domici. em Estados não membros da EU						23 750
TISHMAN ESOF	91 579	0.26	EUR	0.26		23 750
						43 800 253

### 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

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						7 506 400
LIQUIDEZ						
À vista						6 012 476
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			266
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			8 216
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			5 834 154
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 332
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			102
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			29 778
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			12 952
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			125 656
						6 012 476
						6 012 476
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos					66	37 294
Valores Passivos						-476 917
						-439 623
						117 092 052
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYH8-USD CBT 03/18	-29	121.47	USD	97.75		-2 834 629
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					8 594 859.99	

Valor da Unidade de Participação: € 13.6235