

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2017-09-30

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.					27 173	1 167 848
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	300 000	120.71%	EUR	120.71%	13 874	376 004
OT 4.125% 04/2027	220 000	114.63%	EUR	114.63%	6 365	258 542
						634 546
Obrigações diversas						
SANTAN 1.625% 06/19	200 000	102.87%	EUR	102.87%	997	206 735
CXGD 1% 01/2022	100 000	101.39%	EUR	101.39%	677	102 065
CXGD 3.75% 01/2018	200 000	101.12%	EUR	101.12%	5 260	207 496
						516 296
Acções						
EDP Renováveis	2 362	7.20	EUR	7.20		17 006
Outros Merc. Regulamentados Nacionais					18	407 183
Títulos de Dívida Pública						
BT 17NOV2017	407 000	100.04%	EUR	100.04%	18	407 183
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					206 408	58 143 076
Títulos de Dívida Pública						
DBR 4.75% 98/2028	230 000	144.40%	EUR	144.40%	2 664	334 782
DBR 4% 04/01/37	220 000	153.13%	EUR	153.13%	6 510	343 387
DBR 4% 01/2018	2 360 000	101.21%	EUR	101.21%	69 830	2 458 433
DBR 3% 07/2020	298 000	110.13%	EUR	110.13%	2 180	330 358
DBR 2.5% 07/2044	505 000	129.23%	EUR	129.23%	3 078	655 670
DBR 1.5% 02/2023	300 000	109.32%	EUR	109.32%	2 811	330 783
DBR 1.5% 05/2023	481 000	109.54%	EUR	109.54%	2 748	529 635
DBR 1.75% 2/2024	200 000	111.71%	EUR	111.71%	2 186	225 598
DBR 0.5% 02/2025	120 000	103.18%	EUR	103.18%	375	124 193
DBR 0.5% 08/27	800 000	100.35%	EUR	100.35%	866	803 658
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	157.57%	EUR	157.57%	6 547	532 831
FRTR 3% 04/2022	960 000	114.78%	EUR	114.78%	12 546	1 114 386
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	133.08%	EUR	133.08%	3 388	395 986
FRTR 1.75% 11/2024	61 000	110.48%	EUR	110.48%	907	68 299
SPGB 4.6% 07/2019	805 000	108.95%	EUR	108.95%	6 391	883 399
SPGB 4.7% 07/2041	170 000	136.84%	EUR	136.84%	1 379	234 005
SPGB 4.4% 10/2023	725 000	122.29%	EUR	122.29%	29 278	915 888
SPGB 3.8%04/24	130 000	119.24%	EUR	119.24%	2 084	157 101
SPGB 0.25% 04/2018	218 000	100.30%	EUR	100.30%	230	218 880
SPGB 1.95%04/26	157 000	105.24%	EUR	105.24%	1 292	166 520
SPGB 3.45% 07/66	271 000	106.26%	EUR	106.26%	1 614	289 570
SPGB0.4% 04/22	873 000	100.63%	EUR	100.63%	1 473	879 930
BTPS 4.75% 08/2023	305 000	120.58%	EUR	120.58%	2 401	370 167
BTPS 5% 03/2025	514 000	123.47%	EUR	123.47%	2 130	636 776
BTPS 4.5% 05/2023	254 000	118.55%	EUR	118.55%	4 752	305 864

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BTPS 4.5% 03/2024	400 000	119.23%	EUR	119.23%	1 492	478 428
TB 0.826% 02/2018	370 000	99.64%	USD	99.64%	1 698	313 795
SPGB 6% 31/01/2029	310 000	143.79%	EUR	143.79%	12 383	458 120
						14 556 442
Obrigações diversas						
BCPPL 0.75% 05/22	200 000	100.54%	EUR	100.54%	505	201 583
DAIGR Float 07/24	1 100 000	100.07%	EUR	100.07%	327	1 101 086
VW Float 07/19	100 000	100.04%	EUR	100.04%	5	100 048
VW Float 07/21	200 000	100.04%	EUR	100.04%	58	200 144
ACAFP Float 04/22	700 000	102.06%	EUR	102.06%	666	715 079
MCFP Float 11/18	200 000	100.31%	EUR	100.31%		200 624
BNP Float 06/24	600 000	101.29%	EUR	101.29%	168	607 920
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.91%	EUR	100.91%	64	403 704
HSBC Float 09/22	350 000	101.43%	EUR	101.43%	14	355 019
RBS Float 06/20	500 000	100.49%	EUR	100.49%	32	502 482
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.03%	EUR	101.03%	125	1 010 395
CABKSM 1.25% 01/27	400 000	102.11%	EUR	102.11%	3 603	412 047
IBESM Float 02/24	700 000	100.95%	EUR	100.95%	272	706 936
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.63%	EUR	101.63%	192	1 016 482
BBVASM Float 04/22	1 000 000	101.22%	EUR	101.22%	605	1 012 805
SABSM 1% 04/27	300 000	99.25%	EUR	99.25%	1 299	299 037
SCANIA Float 10/18	100 000	100.23%	EUR	100.23%	3	100 237
SCANIA Float 04/20	300 000	100.34%	EUR	100.34%	42	301 071
SRGIM Float 08/24	1 000 000	99.47%	EUR	99.47%	117	994 767
MS Float 01/22	300 000	101.03%	EUR	101.03%	204	303 285
BAC Float 02/22	200 000	101.34%	EUR	101.34%	144	202 822
BAC Float 05/23	450 000	101.05%	EUR	101.05%	326	455 055
MS Float 11/22	300 000	101.04%	EUR	101.04%	167	303 278
GM Float 05/21	800 000	100.57%	EUR	100.57%	407	804 991
T Float 09/2023	1 000 000	101.89%	EUR	101.89%	376	1 019 316
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.26%	EUR	100.26%		1 002 640
BATSLN Float 08/21	500 000	100.48%	EUR	100.48%	109	502 504
NDASS Float 09/21	200 000	101.49%	EUR	101.49%	4	202 984
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.45%	EUR	100.45%	481	804 081
LANSNA 0.875% 02/27	300 000	99.25%	EUR	99.25%	1 640	299 375
VW Float 03/19	200 000	100.09%	EUR	100.09%	0	200 184
MYL Float 05/20	200 000	99.99%	EUR	99.99%	36	200 008
SYDBDC Float 05/18	400 000	100.21%	EUR	100.21%	98	400 942
BRF 0.5% 10/26	200 000	97.24%	EUR	97.24%	910	195 392
KBCBB Float 11/22	400 000	100.76%	EUR	100.76%	94	403 118
DLTAS 2008-1 A	755 087	99.40%	EUR	99.40%	33	750 605
CGD S.758 12/2017	4 050 000	99.67%	EUR	99.67%	1 830	4 038 660
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.55%	EUR	100.55%	28	502 788
NAB Float 04/2021	300 000	101.44%	EUR	101.44%	148	304 477
BMO Float 09/21	200 000	101.27%	EUR	101.27%	3	202 551
BNFP Float 01/2020	700 000	100.44%	EUR	100.44%		703 045
CAFP Float 03/2020	800 000	100.58%	EUR	100.58%	46	804 702

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BFCM Float 03/2019	700 000	101.01%	EUR	101.01%	84	707 154
CBAAU Float 01/2020	700 000	100.71%	EUR	100.71%	95	705 093
DE Float 04/20	300 000	100.45%	EUR	100.45%	11	301 358
JPM Float 01/2020	300 000	101.03%	EUR	101.03%	122	303 209
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.88%	EUR	100.88%	197	605 495
MS Float 11/19	250 000	101.06%	EUR	101.06%	106	252 758
GS Float 07/2022	600 000	102.43%	EUR	102.43%	749	615 329
GS Float 29/05/2020	550 000	101.04%	EUR	101.04%	187	555 913
BAC Float 03/2018	300 000	100.16%	EUR	100.16%	13	300 481
BAC Float 05/2019	600 000	101.73%	EUR	101.73%	1 056	611 412
C Float 11/2019	700 000	100.85%	EUR	100.85%	220	706 163
CS Float 10/2019	700 000	100.80%	EUR	100.80%	176	705 762
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.48%	EUR	100.48%		200 960
MMM Float 05/20	600 000	100.44%	EUR	100.44%		602 622
ANNGR Float 09/18	200 000	100.13%	EUR	100.13%	5	200 255
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.89%	EUR	100.89%	19	807 099
UNANA Float 06/18	500 000	100.15%	EUR	100.15%		500 765
POHBK Float 03/20	500 000	100.58%	EUR	100.58%		502 905
RY Float 03/2019	300 000	100.61%	EUR	100.61%	4	301 843
SKYLN Float 04/20	300 000	101.10%	EUR	101.10%	314	303 626
ENELIM Float 02/2018	150 000	101.16%	EUR	101.16%	483	152 223
CAT Float 05/2018	500 000	100.10%	EUR	100.10%		500 485
JYBC Float 03/2018	400 000	100.14%	EUR	100.14%	1	400 561
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.58%	EUR	100.58%		502 875
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.67%	EUR	100.67%		302 022
FDX Float 04/19	300 000	100.41%	EUR	100.41%	150	301 383
CAPFP Float 07/2018	300 000	100.33%	EUR	100.33%	389	301 373
VW Float 07/2018	200 000	100.07%	EUR	100.07%		200 146
F Float 02/2018	800 000	100.09%	EUR	100.09%	164	800 868
ISPIM Float 04/2019	500 000	101.33%	EUR	101.33%	759	507 404
ISPIM Float 06/20	800 000	102.09%	EUR	102.09%	256	816 968
GE Float 01/2020	1 000 000	100.58%	EUR	100.58%	96	1 005 846
GIS Float 01/2020	400 000	101.26%	EUR	101.26%	337	405 373
MCD Float 08/2019	300 000	100.33%	EUR	100.33%		300 975
						41 136 974
Acções						
BMW	159	85.83	EUR	85.83		13 647
SIEMENS	784	119.20	EUR	119.20		93 453
ALLIANZ	575	189.95	EUR	189.95		109 221
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.58	EUR	9.58		14 881
BASF	468	90.04	EUR	90.04		42 139
BAYER AG	531	115.30	EUR	115.30		61 224
SAP SE	392	92.69	EUR	92.69		36 334
LUFTHANSA	1 314	23.51	EUR	23.51		30 892
DEUTSCHE TELEKOM	3 624	15.79	EUR	15.79		57 205
DAIMLER CHRYSLER	545	67.47	EUR	67.47		36 771

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
THYSSEN KRUPP	555	25.08	EUR	25.08		13 917
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	21.27	EUR	21.27		42 008
VOLKSWAGEN AG-PREF.	149	138.00	EUR	138.00		20 562
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	68.25	EUR	68.25		47 912
DEUTSCHE WOHNEN	420	35.92	EUR	35.92		15 086
ZALANDO SE	476	42.40	EUR	42.40		20 182
FRAPORT AG	309	80.34	EUR	80.34		24 825
DANONE	858	66.37	EUR	66.37		56 945
TOTAL SA	1 871	45.45	EUR	45.45		85 028
Kering	115	337.05	EUR	337.05		38 761
BNP	715	68.25	EUR	68.25		48 799
AIR LIQUIDE	132	112.85	EUR	112.85		14 896
SCHNEIDER	827	73.63	EUR	73.63		60 892
L.V.M.H.	331	233.45	EUR	233.45		77 272
RENAULT SA	244	83.11	EUR	83.11		20 279
SOCIETE GENERALE	1 528	49.54	EUR	49.54		75 689
VALEO SA	615	62.78	EUR	62.78		38 610
PUBLICIS	306	59.09	EUR	59.09		18 082
GLE ENTREP. VINCI	732	80.40	EUR	80.40		58 853
SANOFI SYNHLABO	311	84.01	EUR	84.01		26 127
ARKEMA	179	103.75	EUR	103.75		18 571
ILIAD SA	86	224.85	EUR	224.85		19 337
AMUNDI SA	578	70.32	EUR	70.32		40 645
DIAGEO ORD.	461	24.53	GBP	27.83		12 827
3I GROUP	3 640	9.13	GBP	10.36		37 697
Imperial Brands PLC	392	31.84	GBP	36.12		14 158
RECKITT BENCKISER	219	68.13	GBP	77.28		16 925
OCADO GROUP PLC	3 429	2.93	GBP	3.32		11 385
SHIRE PLC	753	37.88	GBP	42.97		32 355
AMADEUS HOLDING SA	640	54.99	EUR	54.99		35 194
ROYAL DUTCH SHELL B	400	22.95	GBP	26.03		10 411
BCO SANTANDER C.HISP	19 576	5.91	EUR	5.91		115 635
IBERDROLA	3 831	6.57	EUR	6.57		25 177
REPSOL	1 183	15.59	EUR	15.59		18 443
INDITEX	1 421	31.89	EUR	31.89		45 309
TELECOM ITALIA	16 896	0.79	EUR	0.79		13 390
BANCA INTESA	9 570	2.99	EUR	2.99		28 633
ENEL	5 499	5.10	EUR	5.10		28 017
Leonardo SpA	1 669	15.85	EUR	15.85		26 454
AZIMUT HOLDING SPA	2 206	18.30	EUR	18.30		40 370
FINECOBANK SPA	2 619	7.50	EUR	7.50		19 643
ESSITY AKTIEBO-B	619	221.60	SEK	22.99		14 233
ALFA LAVAL AB	1 422	198.90	SEK	20.64		29 348
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	15.82	EUR	15.82		8 511
ING GROEP NV	5 714	15.60	EUR	15.60		89 138
UNILEVER NV-CVA	1 602	50.04	EUR	50.04		80 164
ASML NA	521	144.05	EUR	144.05		75 050

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AKZO NOBEL NV NLG20	227	78.12	EUR	78.12		17 733
ALTICE NV A-W/I	1 276	16.95	EUR	16.95		21 622
VESTAS WIND SYSTEMS	340	565.00	DKK	75.92		25 814
FLSMIDTH & CO A/S	441	416.30	DKK	55.94		24 670
PANDORA A/S	320	621.50	DKK	83.52		26 725
ANHEUSER-BUSCH INB	891	101.30	EUR	101.30		90 258
CRH ORD	481	32.20	EUR	32.20		15 486
ARCELOR MITTAL	909	21.83	EUR	21.83		19 839
						2 449 660
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					84	1 327 192
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.41%	EUR	100.41%		301 224
UBS Float 09/22	700 000	101.34%	EUR	101.34%	79	709 431
AGN Float 06/19	300 000	100.09%	EUR	100.09%	5	300 287
						1 310 942
Acções						
SUNRISE COM. GROUP	233	79.80	CHF	69.74		16 249
						61 045 299

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						16 765 804
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.48	EUR	4.48		9 857 599
CXG IMOBILIARIO	773 940	3.65	EUR	3.65		2 826 351
CXG PRIVATE EQUITY	50 512	5.98	EUR	5.98		302 244
CXG INFRAESTRUTURAS	116 657	6.63	EUR	6.63		773 191
CXG LIQUIDEZ	563 464	5.34	EUR	5.34		3 006 419
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						31 397 328
SGAM FD ABSOL RETRN	89	1 080.26	EUR	1 080.26		96 143
MS EUROCORP DURHED Z	180 722	29.82	EUR	29.82		5 389 130
BROCK EURO MKT Fd D2	70 826	33.00	EUR	33.00		2 337 258
PIONEER EUROLND EQ I	243 428	9.47	EUR	9.47		2 305 263
BANTLEON OPPORTUNIT	8 395	175.15	EUR	175.15		1 470 384
BNY MELLON ABS RET	101 421	1.18	EUR	1.18		119 646
AXA WF EU CREDIT	31 224	136.54	EUR	136.54		4 263 325
Natixis Tresorie I	135	12 546.07	EUR	12 546.07		1 693 719
HENDERSON HPE.ALPHA	8 862	16.75	EUR	16.75		148 439
Schroder ISF Euro Eq	51 097	45.00	EUR	45.00		2 299 191
Theadneedle Credit O	159 980	1.35	EUR	1.35		216 485
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	143.48	EUR	143.48		341 482
PIONEER FUN RT CURRE	116	1 219.65	EUR	1 219.65		141 479
HENDERSON GART UK	47 051	7.20	EUR	7.20		338 541
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.66	EUR	1.66		224 378
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 293.02	EUR	1 293.02		252 139
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	109.31	EUR	109.31		238 507
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	117.74	EUR	117.74		167 540
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 297	1 781.32	EUR	1 781.32		2 310 372

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
MUZINICH LNG/SHT CRD	1 379	103.29	EUR	103.29		142 437
HENDERSON HORIZ.Euro	152 709	14.95	EUR	14.95		2 283 000
BNP PARIBAS MOIS IC	73	23 113.72	EUR	23 113.72		1 687 302
HYPO DJ ESTX 50 FRA	2 712	35.83	EUR	35.83		97 157
ISHARES S&P 500 MONT	49 615	57.12	EUR	57.12		2 834 009
OIC domici. em Estados não membros da EU						23 825
TISHMAN ESOF	91 579	0.26	EUR	0.26		23 825
						48 186 956

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

Depósitos à ordem

DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			341
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			428
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 752 015
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			2 314
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			104
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			30
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			1 013
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			54 061
						1 810 328
						1 810 328

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos

Valores Passivos

27 318
-352 968
-325 650
118 335 386

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

Em mercado regulamentado

Futuros

TYZ7-USD CBT 12/17	-20	125.41	USD	106.16		-2 123 191
--------------------	-----	--------	-----	--------	--	------------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 746 470.05

Valor da Unidade de Participação: € 13.5295