

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
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.					1 259	142 246
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	86 000	97.77%	EUR	97.77%	880	84 962
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	103.11%	EUR	103.11%	379	41 622
Acções						
EDP Renováveis	1 792	8.74	EUR	8.74		15 662
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					55 339	11 757 495
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	100 000	133.26%	EUR	133.26%	4 623	137 887
DBR 4% 04/01/37	195 000	153.81%	EUR	153.81%	5 770	305 692
DBR 3.25% 01/2020	790 000	104.94%	EUR	104.94%	18 992	847 995
DBR 2.5% 07/2044	197 000	133.56%	EUR	133.56%	1 201	264 322
DBR 1.5% 02/2023	45 000	107.51%	EUR	107.51%	422	48 800
DBR 1.75% 2/2024	130 000	109.72%	EUR	109.72%	1 421	144 051
BKO 0% 12/18	163 000	100.05%	EUR	100.05%		163 088
BKO 0% 03/19	500 000	100.26%	EUR	100.26%		501 315
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	159.38%	EUR	159.38%	2 548	209 742
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	136.86%	EUR	136.86%	345	41 402
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	121.66%	EUR	121.66%	3 355	131 095
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	104.08%	EUR	104.08%	1 509	199 266
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	142.19%	EUR	142.19%	406	71 499
SPGB 3.45% 07/66	51 000	115.38%	EUR	115.38%	304	59 146
SPGB 0.45% 10/22	286 000	100.52%	EUR	100.52%	1 181	288 668
BTPS 4% 2/2037	170 000	107.78%	EUR	107.78%	1 127	184 360
BTPS 4.75% 08/2023	80 000	110.69%	EUR	110.69%	630	89 185
BTPS 4.25% 09/2019	5 000	103.24%	EUR	103.24%	18	5 180
BTPS 4.5% 05/2023	108 000	109.27%	EUR	109.27%	2 021	120 027
BTPS 4.5% 03/2024	90 000	109.72%	EUR	109.72%	336	99 081
BTPS 2% 12/2025	400 000	94.88%	EUR	94.88%	2 667	382 167
SPGB 6% 31/01/2029	80 000	142.85%	EUR	142.85%	3 196	117 472
						4 411 440
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	102.27%	EUR	102.27%	9	51 143
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	100 000	99.55%	EUR	99.55%	32	99 585
BASGR Float 11/19	100 000	100.27%	EUR	100.27%		100 274
SAPGR Float 03/21	100 000	100.43%	EUR	100.43%		100 431
ACAFP Float 04/22	100 000	100.51%	EUR	100.51%	97	100 603
MCFP Float 11/18	60 000	100.03%	EUR	100.03%		60 020
BNP Float 06/24	100 000	99.94%	EUR	99.94%	29	99 968
RENAUL Float 03/2022	100 000	100.15%	EUR	100.15%	17	100 167
RENAULT Float 11/24	50 000	98.76%	EUR	98.76%	20	49 402

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ALDFP Float 11/20	100 000	100.02%	EUR	100.02%	11	100 031
HSBC Float 09/22	100 000	100.51%	EUR	100.51%	4	100 514
LLOYDS Float 06/2024	100 000	99.49%	EUR	99.49%	13	99 507
HSBC 0.17% 10/23	100 000	99.65%	EUR	99.65%	44	99 693
RBS Float 09/21	100 000	100.18%	EUR	100.18%	6	100 187
SANTAN Float 03/22	100 000	101.07%	EUR	101.07%	20	101 087
BKTSM 1.25% 02/28	200 000	100.96%	EUR	100.96%	1 616	203 534
AMSSM Float 03/22	100 000	100.24%	EUR	100.24%	5	100 245
SCANIA Float 04/20	100 000	100.18%	EUR	100.18%	16	100 200
BAC Float 05/23	100 000	100.57%	EUR	100.57%	72	100 641
MS Float 11/22	100 000	100.39%	EUR	100.39%	57	100 442
GM Float 05/21	100 000	100.27%	EUR	100.27%	52	100 324
T Float 09/2023	100 000	101.20%	EUR	101.20%	40	101 239
MS Float 05/21	100 000	100.01%	EUR	100.01%	9	100 019
NDASS Float 09/21	100 000	100.84%	EUR	100.84%	2	100 846
SCANIA Float 03/21	100 000	99.85%	EUR	99.85%	5	99 854
VW Float 03/19	100 000	100.06%	EUR	100.06%	0	100 057
ALVGR Float 12/20	200 000	100.93%	EUR	100.93%	24	201 878
DAIGR Float 04/20	100 000	100.41%	EUR	100.41%	42	100 455
NYKRE Float 06/22	100 000	99.90%	EUR	99.90%	20	99 919
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.25%	EUR	100.25%	11	100 260
KBCBB Float 11/22	100 000	99.91%	EUR	99.91%	24	99 931
DLTAS 2008-1 A	69 527	99.50%	EUR	99.50%	2	69 185
SUMIBK Float 06/22	100 000	99.94%	EUR	99.94%	6	99 947
MIZUHO Float 04/23	100 000	100.13%	EUR	100.13%	41	100 172
BCHINA Float 11/20	100 000	99.85%	EUR	99.85%	17	99 865
CAFP Float 03/2020	100 000	100.32%	EUR	100.32%	6	100 329
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.54%	EUR	100.54%	21	100 556
CBAAUFloat 01/2020	100 000	100.44%	EUR	100.44%	15	100 451
UPS Float 07/2020	100 000	100.59%	EUR	100.59%	23	100 615
DE Float 04/20	100 000	100.31%	EUR	100.31%	6	100 312
GS Float 07/2022	75 000	101.61%	EUR	101.61%	95	76 303
GS Float 29/05/2020	125 000	100.74%	EUR	100.74%	44	125 971
BAC Float 05/2019	100 000	100.60%	EUR	100.60%	177	100 772
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.36%	EUR	100.36%		65 236
MMM Float 05/20	100 000	100.41%	EUR	100.41%		100 413
ARRFP Float 01/2020	100 000	100.65%	EUR	100.65%	95	100 741
POHBK Float 03/20	100 000	100.29%	EUR	100.29%		100 294
SKYLN Float 04/20	100 000	100.72%	EUR	100.72%	108	100 831
VOD Float 02/2019	100 000	100.33%	EUR	100.33%	61	100 392
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.40%	EUR	100.40%		150 600
ISPIM Float 04/2019	100 000	100.16%	EUR	100.16%	154	100 318
GE Float 01/2020	100 000	100.23%	EUR	100.23%	11	100 239
GIS Float 01/2020	100 000	100.77%	EUR	100.77%	87	100 855
BMW Float 03/2019	100 000	100.12%	EUR	100.12%	2	100 121
MCD Float 08/2019	100 000	100.20%	EUR	100.20%		100 198
						5 516 030

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Ações						
SIEMENS	678	110.34	EUR	110.34		74 811
ALLIANZ	77	192.00	EUR	192.00		14 784
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 179	8.78	EUR	8.78		10 352
BASF	414	76.55	EUR	76.55		31 692
BAYER AG	439	76.51	EUR	76.51		33 588
ADIDAS- SALOMON AG	168	210.90	EUR	210.90		35 431
SAP SE	297	106.00	EUR	106.00		31 482
DEUTSCHE TELEKOM	1 390	13.89	EUR	13.89		19 300
DAIMLER CHRYSLER	286	54.35	EUR	54.35		15 544
INFINEON TECHNOLOGIE	1 480	19.57	EUR	19.57		28 964
VOLKSWAGEN AG-PREF.	372	151.60	EUR	151.60		56 395
LEONI AG	749	35.45	EUR	35.45		26 552
FRESENIUS SE&CO KGAA	535	63.24	EUR	63.24		33 833
COVESTRO AG	177	69.86	EUR	69.86		12 365
DANONE	567	66.70	EUR	66.70		37 819
PERNOD RICARD	70	141.30	EUR	141.30		9 891
TOTAL SA	1 607	55.84	EUR	55.84		89 735
Kering	81	461.70	EUR	461.70		37 398
PEUGEOT CITROEN	1 928	23.23	EUR	23.23		44 787
BNP	154	52.71	EUR	52.71		8 117
AIR LIQUIDE	209	113.30	EUR	113.30		23 680
SCHNEIDER	161	69.30	EUR	69.30		11 157
L.V.M.H.	226	304.60	EUR	304.60		68 840
ORANGE	2 372	13.74	EUR	13.74		32 579
GLE ENTREP. VINCI	156	82.02	EUR	82.02		12 795
SANOFI SYNHLABO	243	76.56	EUR	76.56		18 604
AIRBUS SE	473	108.18	EUR	108.18		51 169
ARKEMA	96	106.70	EUR	106.70		10 243
SAFRAN SA	383	120.70	EUR	120.70		46 228
3I GROUP	1 808	9.41	GBP	10.57		19 111
RECKITT BENCKISER	168	70.16	GBP	78.79		13 237
WEIR GROUP PLC	736	17.63	GBP	19.80		14 572
OCADO GROUP PLC	1 605	8.99	GBP	10.10		16 208
ADMIRAL GROUP PLC	1 581	20.80	GBP	23.36		36 931
ASHTREAD GROUP PLC	638	24.37	GBP	27.37		17 461
SHIRE PLC	571	46.24	GBP	51.92		29 649
AMADEUS HOLDING SA	429	80.02	EUR	80.02		34 329
ROYAL DUTCH SHELL B	492	26.89	GBP	30.20		14 858
ROTORK PLC	4 294	3.31	GBP	3.71		15 938
TELEFONICA	3 826	6.82	EUR	6.82		26 086
BCO SANTANDER C.HISP	15 226	4.34	EUR	4.34		66 012
IBERDROLA	2 906	6.34	EUR	6.34		18 418
MASMOVIL IBERCOM	128	99.40	EUR	99.40		12 723
UNICREDITO ITALIANO	1 817	12.96	EUR	12.96		23 556
ENI SPA	547	16.28	EUR	16.28		8 906

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BANCA INTESA	8 591	2.20	EUR	2.20		18 909
ENEL	3 536	4.41	EUR	4.41		15 601
ESSITY AKTIEBO-B	469	223.40	SEK	21.65		10 152
KONINKLIJKE AHOLD NV	408	19.75	EUR	19.75		8 058
ING GROEP NV	4 007	11.18	EUR	11.18		44 814
UNILEVER NV-CVA	1 274	47.97	EUR	47.97		61 107
ASML NA	327	160.90	EUR	160.90		52 614
AKZO NOBEL NV NLG20	173	80.54	EUR	80.54		13 933
ABN AMRO GROUP NV	1 741	23.45	EUR	23.45		40 826
ASR NEDERLAND NV	967	41.06	EUR	41.06		39 705
EURONEXT NV	335	56.65	EUR	56.65		18 978
VESTAS WIND SYSTEMS	174	434.40	DKK	58.25		10 136
ANHEUSER-BUSCH INB	728	75.22	EUR	75.22		54 760
ERST BK DER OEST.SPA	698	35.78	EUR	35.78		24 974
RAIFFEISEN INTL BK H	1 276	24.80	EUR	24.80		31 645
TENARIS SA	1 310	14.43	EUR	14.43		18 903
ARCELOR MITTAL	658	26.80	EUR	26.80		17 634
						1 778 882
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					21	297 044
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	97.95%	EUR	97.95%	4	97 956
F Float 05/21	100 000	98.99%	EUR	98.99%	15	99 000
AGN Float 06/19	100 000	100.09%	EUR	100.09%	2	100 088
						297 044

12 196 785

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						3 587 545
CXG OBRIGAÇÕES	390 013	4.45	EUR	4.45		1 735 712
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.86	EUR	3.86		742 843
CXG PRIVATE EQUITY	16 936	5.48	EUR	5.48		92 808
CXG INFRAESTRUTURAS	27 450	7.21	EUR	7.21		197 887
CXG LIQUIDEZ	112 692	5.33	EUR	5.33		600 569
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	2.84	EUR	2.84		47 774
FUNDIESTAMO I	58	1 068.29	EUR	1 068.29		61 961
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.44	EUR	10.44		75 212
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	1.95	EUR	1.95		32 780
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						8 146 343
BROCK EURO MKT Fd D2	35 038	32.57	EUR	32.57		1 141 188
Amundi Funds II-Eur	121 886	9.47	EUR	9.47		1 154 260
Janus Hend H. Pan Al	1 764	16.53	EUR	16.53		29 159
Schroder ISF Euro Eq	25 669	45.30	EUR	45.30		1 162 860
MERRILL LYNCH MARSH	469	146.04	EUR	146.04		68 493
JAN HND UK Abs Ret	9 278	7.20	EUR	7.20		66 763
Merian Global Invest	26 555	1.64	EUR	1.64		43 643
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 351.53	EUR	1 351.53		51 358

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SCH EUROP ALPHA ABS	431	104.22	EUR	104.22		44 919
LYXOR EPSILON GLOB E	281	123.70	EUR	123.70		34 760
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 828.15	EUR	1 828.15		1 142 594
Janus Hend Horiz Eur	77 610	14.54	EUR	14.54		1 128 449
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 026.52	EUR	1 026.52		114 970
DNCA INVEST-MIURA-I	181	123.05	EUR	123.05		22 272
HYPO DJ ESTX 50 FRA	24 779	34.01	EUR	34.01		842 734
ISHARES S&P 500 MONT	16 766	65.49	EUR	65.49		1 097 922
						11 733 889

LIQUIDEZ

À vista						1 392 431
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			411
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			159
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 356 891
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 381
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			59
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			36
DO CGD - USD 0.0000%			USD			460
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			33 034
						1 392 431
						1 392 431

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						6 654
Valores Passivos						-74 076
						-67 421
						25 255 684

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

Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYZ8 USD CBT 12/18	-5	118.86	USD	102.27		-511 355

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 4 056 134.44

Valor da Unidade de Participação: € 6.2265