

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-03-31

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.					25 713	1 530 894
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	1 200 000	123.87%	EUR	123.87%	25 713	1 512 093
Acções						
EDP Renováveis	2 362	7.96	EUR	7.96		18 802
Outros Merc. Regulamentados Nacionais						407 468
Títulos de Dívida Pública						
BT 20JUN2018	407 000	100.12%	EUR	100.12%		407 468
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					165 040	60 668 252
Títulos de Dívida Pública						
DBR 5.5% 01/04/31	1 920 000	159.31%	EUR	159.31%	25 170	3 083 961
DBR 4% 04/01/37	100 000	153.12%	EUR	153.12%	953	154 073
DBR 3% 07/2020	98 000	108.09%	EUR	108.09%	2 183	108 108
DBR 2.5% 07/2044	600 000	131.84%	EUR	131.84%	11 137	802 147
DBR 1.5% 02/2023	1 100 000	108.14%	EUR	108.14%	2 034	1 191 552
DBR 1.5% 05/2023	481 000	108.27%	EUR	108.27%	6 345	527 134
DBR 1.75% 2/2024	1 155 000	110.22%	EUR	110.22%	2 492	1 275 498
DBR 0.5% 08/27	500 000	100.57%	EUR	100.57%	1 788	504 658
BKO 0% 09/18	1 400 000	100.25%	EUR	100.25%		1 403 430
FRTR 4.5% 04/2041	334 000	162.90%	EUR	162.90%	14 042	558 118
FRTR 3% 04/2022	960 000	112.97%	EUR	112.97%	26 906	1 111 399
FRTR 3.25% 5/2045	295 000	139.57%	EUR	139.57%	8 169	419 895
SPGB 4.6% 07/2019	805 000	106.58%	EUR	106.58%	24 856	882 849
SPGB 5.15% 10/2044	250 000	161.95%	EUR	161.95%	5 362	410 237
SPGB 0.25% 04/2018	218 000	100.02%	EUR	100.02%	502	218 554
SPGB 3.45% 07/66	271 000	126.35%	EUR	126.35%	6 276	348 681
SPGB 0.4% 04/22	290 000	101.80%	EUR	101.80%	1 068	296 279
SPGB 0.45% 10/22	1 223 000	101.68%	EUR	101.68%	2 292	1 245 863
BTPS 4.75% 08/2023	305 000	121.04%	EUR	121.04%	2 361	371 524
BTPS 5% 03/2025	514 000	125.25%	EUR	125.25%	2 165	645 940
BTPS 4.5% 05/2023	254 000	119.09%	EUR	119.09%	4 768	307 249
BTPS 4.5% 03/2024	400 000	120.42%	EUR	120.42%	1 516	483 204
						16 350 352
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	102.72%	EUR	102.72%	3	410 871
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	100.15%	EUR	100.15%	325	1 102 019
VW Float 07/19	200 000	100.19%	EUR	100.19%	10	200 386
VW Float 07/21	200 000	100.10%	EUR	100.10%	56	200 256
BASGR Float 11/19	200 000	100.45%	EUR	100.45%		200 894
SAPGR Float 03/21	300 000	100.64%	EUR	100.64%		301 929
ACAFP Float 04/22	900 000	101.35%	EUR	101.35%	814	912 991

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
MCFP Float 11/18	200 000	100.19%	EUR	100.19%		200 370
BNP Float 06/24	600 000	100.88%	EUR	100.88%	176	605 456
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.88%	EUR	100.88%	69	403 593
RENAULT Float 11/24	800 000	100.03%	EUR	100.03%	301	800 509
ALDFP Float 11/20	300 000	100.33%	EUR	100.33%	28	301 012
HSBC Float 09/22	350 000	100.94%	EUR	100.94%	18	353 305
SANUK Float 05/23	200 000	100.35%	EUR	100.35%	103	200 795
RBS Float 06/20	500 000	100.34%	EUR	100.34%	34	501 724
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	100.24%	EUR	100.24%	138	1 002 488
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	99.94%	EUR	99.94%	409	999 829
RBS Float 03/2020	200 000	100.24%	EUR	100.24%	12	200 482
IBESM Float 02/24	700 000	100.90%	EUR	100.90%	266	706 587
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.95%	EUR	101.95%	211	1 019 661
BBVASM Float 04/22	1 000 000	101.16%	EUR	101.16%	595	1 012 165
BKTSM 1.25% 02/28	400 000	101.55%	EUR	101.55%	726	406 930
SCANIA Float 10/18	100 000	100.14%	EUR	100.14%	4	100 139
SCANIA Float 04/20	300 000	100.36%	EUR	100.36%	41	301 109
SRGIM Float 08/24	1 000 000	99.71%	EUR	99.71%	116	997 176
FCABNK Float 06/21	100 000	99.76%	EUR	99.76%	0	99 755
MS Float 01/22	300 000	100.71%	EUR	100.71%	193	302 317
BAC Float 02/22	200 000	101.01%	EUR	101.01%	139	202 163
BAC Float 05/23	450 000	100.85%	EUR	100.85%	311	454 149
GM Float 05/21	800 000	100.65%	EUR	100.65%	374	805 598
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.17%	EUR	100.17%		1 001 720
BATSLN Float 08/21	500 000	100.31%	EUR	100.31%	105	501 660
GS Float 09/23	300 000	99.67%	EUR	99.67%	15	299 022
T Float 09/2023	1 000 000	102.27%	EUR	102.27%	392	1 023 072
C Float 03/23	400 000	99.97%	EUR	99.97%	21	399 885
GM Float 03/22	200 000	100.01%	EUR	100.01%	7	200 025
NDASS Float 09/21	200 000	101.24%	EUR	101.24%	5	202 479
MYL FLOAT 11/18	800 000	100.36%	EUR	100.36%	457	803 329
VW Float 03/19	200 000	100.16%	EUR	100.16%	0	200 324
DAIGR Float 05/22	100 000	100.29%	EUR	100.29%		100 288
MYL Float 05/20	200 000	100.16%	EUR	100.16%	34	200 362
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	100.27%	EUR	100.27%	15	601 623
AEGON 0.375% 11/24	100 000	98.79%	EUR	98.79%	135	98 923
ALVGR Float 12/20	500 000	101.16%	EUR	101.16%	60	505 840
NYKRE Float 06/22	700 000	100.61%	EUR	100.61%	142	704 419
JYBC Float 06/20	400 000	100.41%	EUR	100.41%	8	401 640
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.40%	EUR	100.40%	46	401 662
KBCBB Float 11/22	400 000	100.77%	EUR	100.77%	84	403 148
DLTAS 2008-1 A	690 495	100.00%	EUR	100.00%	35	690 530
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.35%	EUR	100.35%	31	501 796
NAB Float 04/2021	300 000	101.35%	EUR	101.35%	145	304 192
BMO Float 09/21	200 000	100.88%	EUR	100.88%	4	201 772
BMO Float 03/22	200 000	100.75%	EUR	100.75%	17	201 513
BCHINA Float 11/20	400 000	99.96%	EUR	99.96%	60	399 912

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BNFP Float 01/2020	700 000	100.35%	EUR	100.35%	1	702 416
CAFP Float 03/2020	800 000	100.61%	EUR	100.61%	50	804 914
BFCM Float 03/2019	700 000	100.66%	EUR	100.66%	91	704 739
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.59%	EUR	100.59%	97	704 213
DE Float 04/20	300 000	100.43%	EUR	100.43%	13	301 300
JPM Float 01/2020	300 000	100.83%	EUR	100.83%	115	302 590
ABBAY Float 05/2019	600 000	100.61%	EUR	100.61%	187	603 841
MS Float 11/19	250 000	100.90%	EUR	100.90%	103	252 351
GS Float 07/2022	600 000	101.95%	EUR	101.95%	728	612 428
GS Float 29/05/2020	750 000	100.70%	EUR	100.70%	248	755 521
BAC Float 05/2019	600 000	101.15%	EUR	101.15%	1 018	607 918
C Float 11/2019	700 000	100.70%	EUR	100.70%	206	705 106
CS Float 10/2019	700 000	100.60%	EUR	100.60%	176	704 369
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.54%	EUR	100.54%		201 070
MMM Float 05/20	600 000	100.54%	EUR	100.54%		603 258
ANNGR Float 09/18	200 000	100.09%	EUR	100.09%	6	200 190
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.64%	EUR	100.64%	28	805 116
UNANA Float 06/18	500 000	100.04%	EUR	100.04%		500 200
POHBK Float 03/20	500 000	100.47%	EUR	100.47%		502 355
RY Float 03/2019	300 000	100.40%	EUR	100.40%	5	301 193
SKYLN Float 04/20	300 000	100.94%	EUR	100.94%	312	303 141
CAT Float 05/2018	500 000	100.02%	EUR	100.02%		500 110
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.46%	EUR	100.46%		502 305
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.57%	EUR	100.57%		301 701
FDX Float 04/19	300 000	100.34%	EUR	100.34%	147	301 176
CAPFP Float 07/2018	300 000	100.05%	EUR	100.05%	386	300 530
VW Float 07/2018	200 000	100.05%	EUR	100.05%		200 098
ISPIM Float 04/2019	500 000	100.84%	EUR	100.84%	741	504 936
ISPIM Float 06/20	800 000	101.63%	EUR	101.63%	273	813 281
GE Float 01/2020	1 000 000	100.33%	EUR	100.33%	100	1 003 370
GIS Float 01/2020	400 000	100.97%	EUR	100.97%	334	404 222
MCD Float 08/2019	300 000	100.36%	EUR	100.36%		301 065
						41 555 946
Ações						
SIEMENS	354	103.52	EUR	103.52		36 646
ALLIANZ	102	183.40	EUR	183.40		18 707
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.02	EUR	9.02		14 017
BASF	531	82.47	EUR	82.47		43 792
BAYER AG	531	91.79	EUR	91.79		48 740
ADIDAS- SALOMON AG	168	196.65	EUR	196.65		33 037
SAP SE	392	84.97	EUR	84.97		33 308
LUFTHANSA	1 104	25.94	EUR	25.94		28 638
DEUTSCHE TELEKOM	1 833	13.25	EUR	13.25		24 287
DAIMLER CHRYSLER	930	68.97	EUR	68.97		64 142
INFINEON TECHNOLOGIE	1 975	21.74	EUR	21.74		42 937
DEUTSCHE POST	1 302	35.52	EUR	35.52		46 247
VOLKSWAGEN AG-PREF.	490	161.38	EUR	161.38		79 076

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RHEINMETALL AG	405	114.95	EUR	114.95		46 555
FRESENIUS SE&CO KGAA	702	62.06	EUR	62.06		43 566
COVESTRO AG	187	79.86	EUR	79.86		14 934
VONOVIA SE	307	40.25	EUR	40.25		12 357
DANONE	858	65.73	EUR	65.73		56 396
TOTAL SA	1 384	46.13	EUR	46.13		63 844
Kering	137	388.80	EUR	388.80		53 266
BNP	204	60.17	EUR	60.17		12 275
AIR LIQUIDE	250	99.48	EUR	99.48		24 870
SCHNEIDER	383	71.34	EUR	71.34		27 323
L.V.M.H.	349	250.20	EUR	250.20		87 320
ACCOR	321	43.85	EUR	43.85		14 076
ORANGE	3 300	13.79	EUR	13.79		45 491
GLE ENTREP. VINCI	335	79.90	EUR	79.90		26 767
SANOFI SYNHLABO	311	65.33	EUR	65.33		20 318
AIRBUS SE	601	93.80	EUR	93.80		56 374
ARKEMA	117	106.00	EUR	106.00		12 402
HSBC HOLDINGS	4 222	6.65	GBP	7.60		32 068
DIAGEO ORD.	461	24.12	GBP	27.53		12 693
3I GROUP	4 075	8.59	GBP	9.81		39 957
Imperial Brands PLC	392	24.26	GBP	27.69		10 856
RECKITT BENCKISER	219	60.34	GBP	68.88		15 084
OCADO GROUP PLC	2 109	5.31	GBP	6.06		12 779
ASHTREAD GROUP PLC	1 350	19.40	GBP	22.15		29 896
SHIRE PLC	753	35.71	GBP	40.76		30 690
AMADEUS HOLDING SA	640	59.98	EUR	59.98		38 387
ROYAL DUTCH SHELL B	620	22.77	GBP	25.99		16 115
ROTORK PLC	9 700	2.84	GBP	3.25		31 479
TELEFONICA	5 906	8.03	EUR	8.03		47 413
BCO SANTANDER C.HISP	15 885	5.30	EUR	5.30		84 111
IBERDROLA	3 831	5.97	EUR	5.97		22 879
REPSOL	985	14.42	EUR	14.42		14 199
MASMOVIL IBERCOM	169	120.00	EUR	120.00		20 280
MEDIOBANCA	4 235	9.55	EUR	9.55		40 436
BANCA INTESA	12 563	2.95	EUR	2.95		37 105
ENEL	5 499	4.97	EUR	4.97		27 330
FINECOBANK SPA	3 936	9.77	EUR	9.77		38 447
CATTOLICA ASSIC	5 279	8.65	EUR	8.65		45 663
ESSITY AKTIEBO-B	619	230.60	SEK	22.43		13 885
KONINKLIJKE AHOLD NV	538	19.24	EUR	19.24		10 352
ING GROEP NV	5 962	13.70	EUR	13.70		81 679
UNILEVER NV-CVA	1 602	45.87	EUR	45.87		73 484
ASML NA	521	160.15	EUR	160.15		83 438
AKZO NOBEL NV NLG20	227	76.74	EUR	76.74		17 420
ABN AMRO GROUP NV	1 204	24.47	EUR	24.47		29 462
VESTAS WIND SYSTEMS	220	429.80	DKK	57.65		12 684
ANHEUSER-BUSCH INB	891	89.28	EUR	89.28		79 548

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BPOST SA	980	18.36	EUR	18.36		17 993
OMV AG	366	47.28	EUR	47.28		17 304
ERST BK DER OEST.SPA	949	40.80	EUR	40.80		38 719
RAIFFEISEN INTL BK H	1 516	31.59	EUR	31.59		47 890
AIB GROUP PLC	4 965	4.89	EUR	4.89		24 289
ARCELOR MITTAL	909	25.70	EUR	25.70		23 361
						2 351 082
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					111	1 808 202
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.28%	EUR	100.28%		300 843
F Float 12/21	500 000	99.93%	EUR	99.93%	18	499 653
UBS Float 09/22	700 000	101.03%	EUR	101.03%	87	707 283
AGN Float 06/19	300 000	100.14%	EUR	100.14%	6	300 423
						1 808 202
						64 414 816

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						14 406 672
CXG OBRIGAÇÕES	2 200 406	4.47	EUR	4.47		9 839 776
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.73	EUR	3.73		2 796 145
CXG PRIVATE EQUITY	54 309	5.67	EUR	5.67		307 693
CXG INFRAESTRUTURAS	119 942	6.64	EUR	6.64		796 283
CXG LIQUIDEZ	124 904	5.34	EUR	5.34		666 775
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						21 255 791
MS EUROCORP DURHED Z	180 722	29.76	EUR	29.76		5 378 287
BROCK EURO MKT Fd D2	56 302	31.75	EUR	31.75		1 787 589
Amundi Funds II-Eur	195 755	9.02	EUR	9.02		1 765 710
Janus Hend H. Pan Al	8 862	16.62	EUR	16.62		147 286
Schroder ISF Euro Eq	41 285	44.14	EUR	44.14		1 822 481
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	144.22	EUR	144.22		343 244
JAN HND UK Abs Ret	47 051	7.13	EUR	7.13		335 281
OLD MUTUAL GLOB EQ	134 786	1.72	EUR	1.72		231 522
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 331.35	EUR	1 331.35		259 613
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	106.22	EUR	106.22		231 777
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	128.85	EUR	128.85		183 346
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 735.48	EUR	1 735.48		1 815 312
Janus Hend Horiz Eur	124 650	14.21	EUR	14.21		1 771 277
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 024.81	EUR	1 024.81		588 241
DNCA INVEST-MIURA-I	917	131.36	EUR	131.36		120 457
ISHARES STOXX EU 600	31 470	17.26	EUR	17.26		543 046
HYPO DJ ESTX 50 FRA	59 232	33.61	EUR	33.61		1 990 788
ISHARES S&P 500 MONT	32 713	59.32	EUR	59.32		1 940 535
OIC domici. em Estados não membros da EU						1 151 050
TISHMAN ESOE	91 579	0.26	EUR	0.26		23 750
ISHARES MSCI EMER.MK	28 890	47.96	USD	39.02		1 127 300

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						36 813 513

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						7 196 815
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			264
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			8 202
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			7 023 283
DO RBS - EUR AJ 0.0000%			EUR			20
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 839
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			102
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			47
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			13 097
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			149 961
						7 196 815
						7 196 815

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						21 306
Valores Passivos						-350 577
						-329 272
						115 602 273

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado						
Futuros						
TYM8-USD CBT 06/18	-17	121.16	USD	98.57		-1 675 743

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 583 101.46

Valor da Unidade de Participação: € 13.4686