

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2018-12-31

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.					5 328	357 517
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	335 000	99.65%	EUR	99.65%	5 328	339 152
Acções						
EDP Renováveis	2 362	7.78	EUR	7.78		18 365
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					296 127	62 370 560
Títulos de Dívida Pública						
DBR 4.75% 98/2028	375 000	142.96%	EUR	142.96%	8 833	544 941
DBR 5.5% 01/04/31	813 000	160.70%	EUR	160.70%	44 347	1 350 855
DBR 4% 04/01/37	139 000	157.51%	EUR	157.51%	5 514	224 456
DBR 3.25% 01/2020	1 970 000	103.99%	EUR	103.99%	63 499	2 112 043
DBR 3% 07/2020	518 000	105.50%	EUR	105.50%	7 706	554 207
DBR 2.5% 07/2044	642 000	138.69%	EUR	138.69%	7 959	898 317
DBR 1.5% 02/2023	1 177 000	107.95%	EUR	107.95%	15 478	1 286 097
DBR 1.5% 05/2023	210 000	108.29%	EUR	108.29%	1 994	229 405
DBR 1.75% 2/2024	487 000	110.45%	EUR	110.45%	7 472	545 344
DBR 0.5% 08/27	321 000	103.32%	EUR	103.32%	611	332 278
FRTR 4.5% 04/2041	357 000	159.87%	EUR	159.87%	11 047	581 790
FRTR 3% 04/2022	1 027 000	111.10%	EUR	111.10%	21 187	1 162 133
FRTR 3.25% 5/2045	316 000	137.35%	EUR	137.35%	6 218	440 247
SPGB 4.6% 07/2019	1 084 000	102.89%	EUR	102.89%	21 175	1 136 470
SPGB 5.15% 10/2044	268 000	150.99%	EUR	150.99%	2 344	406 995
SPGB 3.45% 07/66	290 000	114.11%	EUR	114.11%	4 249	335 179
SPGB0.4% 04/22	310 000	101.36%	EUR	101.36%	836	315 055
SPGB 0.45% 10/22	1 309 000	101.33%	EUR	101.33%	1 001	1 327 358
BTPS 4% 2/2037	831 000	110.94%	EUR	110.94%	13 820	935 706
BTPS 5% 03/2025	382 000	116.29%	EUR	116.29%	6 437	450 650
BTPS 4.5% 03/2024	358 000	112.48%	EUR	112.48%	5 429	408 122
BTPS 2% 12/2025	1 302 000	98.46%	EUR	98.46%	2 218	1 284 219
NETHER 5.5% 01/2028	454 000	146.70%	EUR	146.70%	24 012	690 048
RAGB 0.75% 10/26	348 000	103.33%	EUR	103.33%	522	360 110
						17 912 024
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	101.69%	EUR	101.69%	74	406 830
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 100 000	96.83%	EUR	96.83%	366	1 065 496
VW Float 07/19	200 000	99.94%	EUR	99.94%	15	199 897
VW Float 07/21	200 000	98.21%	EUR	98.21%	62	196 482
BASGR Float 11/19	200 000	100.09%	EUR	100.09%		200 180
SAPGR Float 03/21	300 000	99.92%	EUR	99.92%		299 772
VW Float 10/19	200 000	99.95%	EUR	99.95%	15	199 923
VW Float 12/21	200 000	98.35%	EUR	98.35%	47	196 743
CMZB Flt .134% 12/20	300 000	100.03%	EUR	100.03%	31	300 106

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SAPGR Float 12/2020	200 000	100.07%	EUR	100.07%		200 130
ACAAP Float 04/22	900 000	98.81%	EUR	98.81%	857	890 120
BNP Float 06/24	600 000	96.43%	EUR	96.43%	181	578 761
RENAUL Float 03/2022	400 000	96.95%	EUR	96.95%	72	387 876
RENAULT Float 11/24	800 000	91.90%	EUR	91.90%	325	735 533
ALDFP Float 11/20	300 000	99.28%	EUR	99.28%	33	297 867
BNP Float 05/23	500 000	97.20%	EUR	97.20%	169	486 189
HSBC Float 09/22	350 000	98.01%	EUR	98.01%	19	343 047
SANUK Float 05/23	200 000	94.94%	EUR	94.94%	111	189 981
RBS Float 06/20	500 000	99.31%	EUR	99.31%	35	496 605
LLOYDS Float 06/2024	500 000	94.92%	EUR	94.92%	72	474 672
HSBC 0.17% 10/23	1 000 000	95.68%	EUR	95.68%	445	957 265
RBS Float 03/2020	200 000	99.48%	EUR	99.48%	14	198 978
IBESM Float 02/24	700 000	100.31%	EUR	100.31%	289	702 473
SANTAN Float 03/22	1 000 000	99.13%	EUR	99.13%	217	991 527
BBVASM Float 04/22	500 000	99.27%	EUR	99.27%	317	496 687
AMSSM Float 03/22	200 000	98.94%	EUR	98.94%	11	197 897
SCANIA Float 04/20	300 000	99.96%	EUR	99.96%	49	299 938
SRGIM Float 08/24	1 000 000	92.58%	EUR	92.58%	137	925 967
FCABNK Float 06/21	100 000	96.53%	EUR	96.53%	1	96 528
MS Float 01/22	300 000	99.42%	EUR	99.42%	204	298 458
WFC Float 01/22	600 000	98.94%	EUR	98.94%	188	593 852
BAC Float 02/22	200 000	100.05%	EUR	100.05%	147	200 245
BAC Float 05/23	150 000	98.22%	EUR	98.22%	110	147 441
GM Float 05/21	800 000	96.98%	EUR	96.98%	396	776 260
TMO Float 07/2019	1 000 000	100.01%	EUR	100.01%		1 000 140
BATSLN Float 08/21	500 000	97.90%	EUR	97.90%	118	489 593
C Float 03/23	500 000	97.95%	EUR	97.95%	29	489 794
GM Float 03/22	300 000	95.71%	EUR	95.71%	12	287 151
BAC FLOAT 04/24	400 000	96.98%	EUR	96.98%	289	388 213
T Float 0.534% 09/23	1 000 000	98.75%	EUR	98.75%	415	987 940
NDASS Float 09/21	400 000	100.21%	EUR	100.21%	11	400 851
UBS Float 04/2021	500 000	99.95%	EUR	99.95%	178	499 938
SCANIA Float 03/21	200 000	99.53%	EUR	99.53%	12	199 068
DAIGR Float 05/22	100 000	98.31%	EUR	98.31%		98 305
MYL Float 05/20	200 000	99.33%	EUR	99.33%	39	198 695
ANNGR FLOAT 11/19	600 000	99.91%	EUR	99.91%	24	599 490
ALVGR Float 12/20	500 000	100.58%	EUR	100.58%	64	502 959
DAIGR Float 04/20	200 000	99.99%	EUR	99.99%	85	200 067
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.09%	EUR	100.09%	29	500 494
BAYNGR Float 06/22	300 000	99.28%	EUR	99.28%	10	297 856
INTNED Float 09/23	300 000	98.11%	EUR	98.11%	54	294 378
INTNED Float 11/21	200 000	100.05%	EUR	100.05%	21	200 113
ABNANV Flt.084%12/21	200 000	100.01%	EUR	100.01%	14	200 026
NYKRE Float 06/22	700 000	97.03%	EUR	97.03%	143	679 353
JYBC Float 06/20	400 000	100.05%	EUR	100.05%	11	400 211
NYKRE Flt.184% 01/24	300 000	101.45%	EUR	101.45%	38	304 390

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SPOLNO Float 09/21	200 000	99.89%	EUR	99.89%	6	199 782
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.12%	EUR	100.12%	45	400 519
KBCBB Float 11/22	400 000	98.46%	EUR	98.46%	94	393 930
DLTAS 2008-1 A	593 369	99.18%	EUR	99.18%	24	588 528
DE Float 09/20	100 000	99.80%	EUR	99.80%		99 801
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.10%	EUR	99.10%	35	495 535
MIZUHO Float 04/23	500 000	98.63%	EUR	98.63%	210	493 360
NAB Float 04/2021	300 000	100.53%	EUR	100.53%	155	301 751
BMO Float 09/21	200 000	100.42%	EUR	100.42%	4	200 840
BMO Float 03/22	200 000	100.26%	EUR	100.26%	19	200 533
BNFP Float 01/2020	700 000	100.05%	EUR	100.05%	18	700 396
CAFP Float 03/2020	800 000	99.98%	EUR	99.98%	67	799 907
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.20%	EUR	100.20%	115	701 515
UPS Float 07/2020	200 000	100.26%	EUR	100.26%	49	200 575
DE Float 04/20	300 000	99.88%	EUR	99.88%	20	299 672
JPM Float 01/2020	300 000	100.37%	EUR	100.37%	124	301 228
ABBEY Float 05/2019	600 000	100.12%	EUR	100.12%	206	600 932
GS Float 07/2022	600 000	99.39%	EUR	99.39%	763	597 079
GS Float 29/05/2020	750 000	99.99%	EUR	99.99%	264	750 167
C Float 11/2019	700 000	100.26%	EUR	100.26%	228	702 062
CS Float 10/2019	700 000	100.23%	EUR	100.23%	198	701 829
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.07%	EUR	100.07%		200 140
MMM Float 05/20	800 000	99.97%	EUR	99.97%		799 792
ARRFP Float 03/2019	800 000	100.12%	EUR	100.12%	10	800 994
DB Float 04/2019	700 000	99.92%	EUR	99.92%	352	699 799
POHBK Float 03/20	500 000	100.13%	EUR	100.13%		500 630
RY Float 03/2019	300 000	100.09%	EUR	100.09%	6	300 276
SKYLN Float 04/20	300 000	100.18%	EUR	100.18%	331	300 859
UCGIM Float 02/2020	750 000	99.98%	EUR	99.98%	613	750 493
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.15%	EUR	100.15%	2	500 747
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.27%	EUR	100.27%		300 816
FDX Float 04/19	300 000	100.06%	EUR	100.06%	159	300 342
ISPIM Float 04/2019	500 000	100.12%	EUR	100.12%	773	501 368
ISPIM Float 06/20	800 000	99.86%	EUR	99.86%	246	799 094
GE Float 01/2020	1 000 000	98.68%	EUR	98.68%	124	986 894
GIS Float 01/2020	400 000	100.39%	EUR	100.39%	357	401 917
MCD Float 08/2019	300 000	100.00%	EUR	100.00%		299 991
						42 016 009
Acções						
BMW	227	70.70	EUR	70.70		16 049
SIEMENS	316	97.38	EUR	97.38		30 772
ALLIANZ	498	175.14	EUR	175.14		87 220
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	8.63	EUR	8.63		13 406
BASF	423	60.40	EUR	60.40		25 549
BAYER AG	855	60.56	EUR	60.56		51 779
ADIDAS- SALOMON AG	157	182.40	EUR	182.40		28 637

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SAP SE	434	86.93	EUR	86.93		37 728
LUFTHANSA	839	19.70	EUR	19.70		16 528
DEUTSCHE TELEKOM	1 821	14.82	EUR	14.82		26 987
DAIMLER CHRYSLER	377	45.91	EUR	45.91		17 308
INFINEON TECHNOLOGIE	634	17.37	EUR	17.37		11 009
VOLKSWAGEN AG-PREF.	172	138.92	EUR	138.92		23 894
FRESENIUS SE&CO KGAA	401	42.38	EUR	42.38		16 994
WIRECARD AG	90	132.80	EUR	132.80		11 952
VONOVIA SE	1	39.59	EUR	39.59		40
MTU AERO ENGINES	97	158.40	EUR	158.40		15 365
SIEMENS HEALTHIN	455	36.55	EUR	36.55		16 628
DANONE	326	61.51	EUR	61.51		20 052
PERNOD RICARD	360	143.30	EUR	143.30		51 588
TOTAL SA	1 902	46.18	EUR	46.18		87 834
L OREAL	208	201.20	EUR	201.20		41 850
Kering	67	411.60	EUR	411.60		27 577
PEUGEOT CITROEN	1 454	18.65	EUR	18.65		27 110
BNP	204	39.48	EUR	39.48		8 053
AIR LIQUIDE	481	108.45	EUR	108.45		52 164
L.V.M.H.	172	258.20	EUR	258.20		44 410
RENAULT SA	400	54.55	EUR	54.55		21 820
ORANGE	3 300	14.16	EUR	14.16		46 712
GLE ENTREP. VINCI	245	72.02	EUR	72.02		17 645
SANOFI SYNHLABO	696	75.66	EUR	75.66		52 659
AIRBUS SE	623	83.96	EUR	83.96		52 307
SAFRAN SA	682	105.40	EUR	105.40		71 883
PRUDENTIAL CORP.	566	14.02	GBP	15.61		8 836
RECKITT BENCKISER	219	60.13	GBP	66.96		14 663
ANGLO AMERICAN PLC	763	17.48	GBP	19.46		14 850
OCADO GROUP PLC	2 109	7.90	GBP	8.80		18 553
AMADEUS HOLDING SA	191	60.84	EUR	60.84		11 620
DIRECT LINE INSU	9 142	3.19	GBP	3.55		32 443
TELEFONICA	5 905	7.34	EUR	7.34		43 337
BCO SANTANDER C.HISP	20 080	3.97	EUR	3.97		79 778
IBERDROLA	3 324	7.02	EUR	7.02		23 328
REPSOL	1 209	14.08	EUR	14.08		17 023
ACS	493	33.83	EUR	33.83		16 678
INDITEX	915	22.35	EUR	22.35		20 450
CAIXABANK SA	6 575	3.16	EUR	3.16		20 803
MASMOVIL IBERCOM	1 400	19.50	EUR	19.50		27 300
UNICREDITO ITALIANO	2 396	9.89	EUR	9.89		23 706
ENI SPA	722	13.75	EUR	13.75		9 926
BANCA INTESA	11 322	1.94	EUR	1.94		21 962
ENEL	4 661	5.04	EUR	5.04		23 510
MONCLER SPA	1 151	28.93	EUR	28.93		33 298
SANDVIK AB NEW ORDER	1 947	126.35	SEK	12.42		24 190
ESSITY AKTIEBO-B	619	217.60	SEK	21.40		13 245

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UNILEVER NV-CVA	1 928	47.42	EUR	47.42		91 426
ASML NA	467	137.16	EUR	137.16		64 054
AKZO NOBEL NV NLG20	377	70.40	EUR	70.40		26 541
RANDSTAD NV	799	40.09	EUR	40.09		32 032
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 734	12.68	EUR	12.68		21 991
ABN AMRO GROUP NV	921	20.54	EUR	20.54		18 917
ASR NEDERLAND NV	1 010	34.58	EUR	34.58		34 926
NOKIA A	10 157	5.03	EUR	5.03		51 090
KBC BANKVERZEKERING	737	56.68	EUR	56.68		41 773
ERST BK DER OEST.SPA	949	29.05	EUR	29.05		27 568
RAIFFEISEN INTL BK H	961	22.20	EUR	22.20		21 334
CRH ORD	593	23.10	EUR	23.10		13 698
ARCELOR MITTAL	1 066	18.14	EUR	18.14		19 337
						2 035 697
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					467	2 755 573
Obrigações diversas						
KO Float 03/19	300 000	100.04%	EUR	100.04%		300 129
F Float 12/21	500 000	92.90%	EUR	92.90%	22	464 537
UBS Float 09/22	700 000	99.13%	EUR	99.13%	91	693 980
AGN Float 06/19	300 000	99.92%	EUR	99.92%	8	299 759
AGM Float 11/20	100 000	99.39%	EUR	99.39%	4	99 397
SUMIBK Float 09/20	100 000	100.41%	EUR	100.41%	4	100 417
TACHEM Flt.784 11/22	200 000	99.35%	EUR	99.35%	179	198 875
TACHEM Flt.234%11/20	600 000	99.72%	EUR	99.72%	160	598 480
						2 755 573
						65 483 650

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						3 811 268
CXG IMOBILIARIO	749 496	3.86	EUR	3.86		2 889 607
CXG PRIVATE EQUITY	40 509	5.48	EUR	5.48		222 176
CXG INFRAESTRUTURAS	94 830	7.38	EUR	7.38		699 485
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						13 675 237
Amundi Funds II-Eur	242 460	8.01	EUR	8.01		1 942 105
ALLIANZ EUROLDO EQY G	137	2 171.00	EUR	2 171.00		297 427
Janus Hend H. Pan Al	8 862	15.73	EUR	15.73		139 399
Schroder ISF Euro Eq	50 954	37.54	EUR	37.54		1 912 696
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	136.47	EUR	136.47		324 799
JAN HND UK Abs Ret	47 051	6.96	EUR	6.96		327 691
Merian Global Invest	134 786	1.61	EUR	1.61		216 399
MS PSAM GLOB UCITS	195	1 322.23	EUR	1 322.23		257 835
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	102.36	EUR	102.36		223 349
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	116.74	EUR	116.74		166 122
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 529.83	EUR	1 529.83		1 600 202
Janus Hend Horiz Eur	156 391	12.25	EUR	12.25		1 915 790
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 008.33	EUR	1 008.33		578 781

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DNCA INVEST-MIURA-I	917	115.07	EUR	115.07		105 519
iShares EUR STOXX 50	34 240	29.96	EUR	29.96		1 025 659
ISHARES S&P 500 MONT	27 450	56.05	EUR	56.05		1 538 573
XUS TREASURY €	9 610	114.77	EUR	114.77		1 102 892
OIC domici. em Estados não membros da EU						24 719
TISHMAN ESOF	91 579	0.27	EUR	0.27		24 719
						17 511 224

OUTROS ACTIVOS

Imóveis

R Rodrigo Fonseca	5	448 540.00	EUR	448 540.00		2 242 700
REPUBLICA 35- R/C	8	625 512.50	EUR	625 512.50		5 004 100
						7 246 800
						7 246 800

LIQUIDEZ

À vista

14 922 160

Depósitos à ordem

DO DO CGD - CHF 0.0000%		CHF		276
DO DO CGD - DKK 0.0000%		DKK		219
DO DO CGD - EUR 0.0000%		EUR		14 707 890
DO RBS - EUR AJ 0.0000%		EUR		20
DO DO CGD - GBP 0.0000%		GBP		3 506
DO DO CGD - NOK 0.0000%		NOK		99
DO DO CGD - SEK 0.0000%		SEK		28
DO DO CGD - USD 0.0000%		USD		381
DO RBS - USD AJ 0.0000%		USD		209 741
				14 922 160
				14 922 160

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos

3 100

Valores Passivos

-339 920

-336 820

104 827 014

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 055 089.15

Valor da Unidade de Participação: € 13.0138