

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
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.					1 747	142 187
Títulos de Dívida Pública						
PGB 2.25% 04/34	86 000	99.65%	EUR	99.65%	1 368	87 066
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	40 000	102.02%	EUR	102.02%	379	41 188
Acções						
EDP Renováveis	1 792	7.78	EUR	7.78		13 933
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					74 586	10 222 126
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	100 000	132.91%	EUR	132.91%	6 199	139 104
DBR 5.5% 01/04/31	30 000	160.70%	EUR	160.70%	1 636	49 847
DBR 4% 04/01/37	235 000	157.51%	EUR	157.51%	9 323	379 476
DBR 3.25% 01/2020	655 000	103.99%	EUR	103.99%	21 113	702 227
DBR 2.5% 07/2044	201 000	138.69%	EUR	138.69%	2 492	281 249
DBR 1.75% 2/2024	130 000	110.45%	EUR	110.45%	1 995	145 574
BKO 0% 03/19	370 000	100.10%	EUR	100.10%		370 366
FRTR 4.5% 04/2041	130 000	159.87%	EUR	159.87%	4 023	211 856
FRTR 3.25% 5/2045	30 000	137.35%	EUR	137.35%	590	41 796
SPGB 4.8% 01/2024	105 000	121.61%	EUR	121.61%	4 626	132 311
SPGB 4.6% 07/2019	190 000	102.89%	EUR	102.89%	3 712	199 197
SPGB 4.7% 07/2041	50 000	141.18%	EUR	141.18%	998	71 590
SPGB 3.45% 07/66	51 000	114.11%	EUR	114.11%	747	58 945
SPGB 0.45% 10/22	286 000	101.33%	EUR	101.33%	219	290 011
BTPS 4% 2/2037	95 000	110.94%	EUR	110.94%	1 580	106 970
BTPS 4.25% 09/2019	2 000	102.60%	EUR	102.60%	29	2 081
BTPS 4.5% 05/2023	134 000	112.00%	EUR	112.00%	1 016	151 091
BTPS 2% 12/2025	655 000	98.46%	EUR	98.46%	1 116	646 055
NETHER 5.5% 01/2028	140 000	146.70%	EUR	146.70%	7 405	212 790
RAGB 0.75% 10/26	150 000	103.33%	EUR	103.33%	225	155 220
SPGB 6% 31/01/2029	80 000	142.69%	EUR	142.69%	4 405	118 561
						4 466 317
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	101.69%	EUR	101.69%	9	50 854
Obrigações diversas						
BASGR Float 11/19	100 000	100.09%	EUR	100.09%		100 090
SAPGR Float 03/21	100 000	99.92%	EUR	99.92%		99 924
CMZB Flt .134% 12/20	100 000	100.03%	EUR	100.03%	10	100 035
ACAFP Float 04/22	100 000	98.81%	EUR	98.81%	95	98 902
BNP Float 06/24	100 000	96.43%	EUR	96.43%	30	96 460
RENAUL Float 03/2022	100 000	96.95%	EUR	96.95%	18	96 969
RENAULT Float 11/24	50 000	91.90%	EUR	91.90%	20	45 971
ALDFP Float 11/20	100 000	99.28%	EUR	99.28%	11	99 289
HSBC Float 09/22	100 000	98.01%	EUR	98.01%	5	98 013

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
HSBC 0.17% 10/23	100 000	95.68%	EUR	95.68%	44	95 726
RBS Float 09/21	100 000	98.55%	EUR	98.55%	8	98 553
AMSSM Float 03/22	100 000	98.94%	EUR	98.94%	5	98 948
SCANIA Float 04/20	100 000	99.96%	EUR	99.96%	16	99 979
BAC Float 05/23	100 000	98.22%	EUR	98.22%	73	98 294
GM Float 05/21	100 000	96.98%	EUR	96.98%	50	97 033
MS Float 05/21	100 000	99.27%	EUR	99.27%	10	99 282
T Float 0.534% 09/23	100 000	98.75%	EUR	98.75%	42	98 794
NDASS Float 09/21	100 000	100.21%	EUR	100.21%	3	100 213
MYL Float 05/20	100 000	99.33%	EUR	99.33%	19	99 347
ALVGR Float 12/20	200 000	100.58%	EUR	100.58%	26	201 184
DAIGR Float 04/20	100 000	99.99%	EUR	99.99%	42	100 033
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.12%	EUR	100.12%	11	100 130
KBCBB Float 11/22	100 000	98.46%	EUR	98.46%	23	98 482
DLTAS 2008-1 A	65 930	99.18%	EUR	99.18%	3	65 392
SUMIBK Float 06/22	100 000	99.10%	EUR	99.10%	7	99 107
MIZUHO Float 04/23	100 000	98.63%	EUR	98.63%	42	98 672
CAFP Float 03/2020	100 000	99.98%	EUR	99.98%	8	99 988
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.23%	EUR	100.23%	22	100 249
UPS Float 07/2020	100 000	100.26%	EUR	100.26%	24	100 287
DE Float 04/20	100 000	99.88%	EUR	99.88%	7	99 891
GS Float 07/2022	75 000	99.39%	EUR	99.39%	95	74 635
GS Float 29/05/2020	85 000	99.99%	EUR	99.99%	30	85 019
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.07%	EUR	100.07%		65 046
MMM Float 05/20	100 000	99.97%	EUR	99.97%		99 974
ARRFP Float 01/2020	100 000	100.37%	EUR	100.37%	96	100 462
POHBK Float 03/20	100 000	100.13%	EUR	100.13%		100 126
VOD Float 02/2019	100 000	100.07%	EUR	100.07%	63	100 133
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.27%	EUR	100.27%		150 408
ISPIM Float 04/2019	100 000	100.12%	EUR	100.12%	155	100 274
GE Float 01/2020	100 000	98.68%	EUR	98.68%	12	98 689
BMW Float 03/2019	100 000	100.04%	EUR	100.04%	3	100 044
MCD Float 08/2019	100 000	100.00%	EUR	100.00%		99 997
						4 160 045
Ações						
BMW	172	70.70	EUR	70.70		12 160
SIEMENS	239	97.38	EUR	97.38		23 274
ALLIANZ	377	175.14	EUR	175.14		66 028
E.ON AG(EX VEBAG)	1 179	8.63	EUR	8.63		10 171
BASF	321	60.40	EUR	60.40		19 388
BAYER AG	648	60.56	EUR	60.56		39 243
ADIDAS- SALOMON AG	119	182.40	EUR	182.40		21 706
SAP SE	329	86.93	EUR	86.93		28 600
LUFTHANSA	636	19.70	EUR	19.70		12 529
DEUTSCHE TELEKOM	1 380	14.82	EUR	14.82		20 452
DAIMLER CHRYSLER	286	45.91	EUR	45.91		13 130

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
INFINEON TECHNOLOGIE	481	17.37	EUR	17.37		8 353
VOLKSWAGEN AG-PREF.	130	138.92	EUR	138.92		18 060
FRESENIUS SE&CO KGAA	304	42.38	EUR	42.38		12 884
WIRECARD AG	68	132.80	EUR	132.80		9 030
MTU AERO ENGINES	74	158.40	EUR	158.40		11 722
SIEMENS HEALTHIN	345	36.55	EUR	36.55		12 608
DANONE	247	61.51	EUR	61.51		15 193
PERNOD RICARD	273	143.30	EUR	143.30		39 121
TOTAL SA	1 441	46.18	EUR	46.18		66 545
L OREAL	158	201.20	EUR	201.20		31 790
Kering	51	411.60	EUR	411.60		20 992
PEUGEOT CITROEN	1 102	18.65	EUR	18.65		20 547
BNP	154	39.48	EUR	39.48		6 079
AIR LIQUIDE	365	108.45	EUR	108.45		39 584
L.V.M.H.	130	258.20	EUR	258.20		33 566
RENAULT SA	303	54.55	EUR	54.55		16 529
ORANGE	2 611	14.16	EUR	14.16		36 959
GLE ENTREP. VINCI	209	72.02	EUR	72.02		15 052
SANOFI SYNHLABO	527	75.66	EUR	75.66		39 873
AIRBUS SE	473	83.96	EUR	83.96		39 713
SAFRAN SA	516	105.40	EUR	105.40		54 386
PRUDENTIAL CORP.	429	14.02	GBP	15.61		6 697
RECKITT BENCKISER	168	60.13	GBP	66.96		11 249
ANGLO AMERICAN PLC	578	17.48	GBP	19.46		11 249
OCADO GROUP PLC	1 605	7.90	GBP	8.80		14 119
AMADEUS HOLDING SA	142	60.84	EUR	60.84		8 639
DIRECT LINE INSU	6 928	3.19	GBP	3.55		24 586
TELEFONICA	4 475	7.34	EUR	7.34		32 842
BCO SANTANDER C.HISP	15 226	3.97	EUR	3.97		60 493
IBERDROLA	2 519	7.02	EUR	7.02		17 678
REPSOL	916	14.08	EUR	14.08		12 897
ACS	373	33.83	EUR	33.83		12 619
INDITEX	693	22.35	EUR	22.35		15 489
CAIXABANK SA	4 983	3.16	EUR	3.16		15 766
MASMOVIL IBERCOM	1 055	19.50	EUR	19.50		20 573
UNICREDITO ITALIANO	1 817	9.89	EUR	9.89		17 977
ENI SPA	547	13.75	EUR	13.75		7 520
BANCA INTESA	8 591	1.94	EUR	1.94		16 665
ENEL	3 536	5.04	EUR	5.04		17 836
MONCLER SPA	873	28.93	EUR	28.93		25 256
SANDVIK AB NEW ORDER	1 475	126.35	SEK	12.42		18 326
ESSITY AKTIEBO-B	469	217.60	SEK	21.40		10 035
UNILEVER NV-CVA	1 461	47.42	EUR	47.42		69 281
ASML NA	354	137.16	EUR	137.16		48 555
AKZO NOBEL NV NLG20	286	70.40	EUR	70.40		20 134
RANDSTAD NV	606	40.09	EUR	40.09		24 295
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 314	12.68	EUR	12.68		16 664

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ABN AMRO GROUP NV	698	20.54	EUR	20.54		14 337
ASR NEDERLAND NV	766	34.58	EUR	34.58		26 488
NOKIA A	7 697	5.03	EUR	5.03		38 716
KBC BANKVERZEKERING	550	56.68	EUR	56.68		31 174
ERST BK DER OEST.SPA	698	29.05	EUR	29.05		20 277
RAIFFEISEN INTL BK H	728	22.20	EUR	22.20		16 162
CRH ORD	450	23.10	EUR	23.10		10 395
ARCELOR MITTAL	808	18.14	EUR	18.14		14 657
						1 544 910
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					45	295 209
Obrigações diversas						
F Float 05/21	100 000	95.53%	EUR	95.53%	15	95 542
AGN Float 06/19	100 000	99.92%	EUR	99.92%	3	99 920
TACHEM Flt.234%11/20	100 000	99.72%	EUR	99.72%	27	99 747
						295 209
						10 659 521

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						1 177 929
CXG IMOBILIARIO	192 631	3.86	EUR	3.86		742 670
CXG PRIVATE EQUITY	16 936	5.48	EUR	5.48		92 887
CXG INFRAESTRUTURAS	27 450	7.38	EUR	7.38		202 477
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	0.08	EUR	0.08		1 392
FUNDIESTAMO I	58	1 062.66	EUR	1 062.66		61 634
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	10.67	EUR	10.67		76 869
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						7 618 591
Amundi Funds II-Eur	165 856	8.01	EUR	8.01		1 328 507
ALLIANZ EUOLD EQY G	158	2 171.00	EUR	2 171.00		343 018
Janus Hend H. Pan Al	1 764	15.73	EUR	15.73		27 748
Schroder ISF Euro Eq	35 015	37.54	EUR	37.54		1 314 383
MERRILL LYNCH MARSH	469	136.47	EUR	136.47		64 004
JAN HND UK Abs Ret	9 278	6.96	EUR	6.96		64 618
Merian Global Invest	26 555	1.61	EUR	1.61		42 634
MS PSAM GLOB UCITS	38	1 322.23	EUR	1 322.23		50 245
SCH EUROP ALPHA ABS	431	102.36	EUR	102.36		44 117
LYXOR EPSILON GLOB E	281	116.74	EUR	116.74		32 804
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 529.83	EUR	1 529.83		956 144
Janus Hend Horiz Eur	107 334	12.25	EUR	12.25		1 314 842
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 008.33	EUR	1 008.33		112 933
DNCA INVEST-MIURA-I	181	115.07	EUR	115.07		20 828
iShares EUR STOXX 50	15 542	29.96	EUR	29.96		465 561
ISHARES S&P 500 MONT	16 766	56.05	EUR	56.05		939 734
XUS TREASURY €	4 326	114.77	EUR	114.77		496 473
						8 796 519

LIQUIDEZ

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
À vista						4 289 716
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			414
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			160
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			4 245 178
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			2 787
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			56
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			37
DO CGD - USD 0.0000%			USD			615
DO RBS - USD AJ 0.0000%			USD			40 469
						4 289 716
						4 289 716
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						1 651
Valores Passivos						-74 063
						-72 411
						23 673 345
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					4 050 305.64	

Valor da Unidade de Participação: € 5.8448