

CRÉDITO AGRÍCOLA VIDA - COMPANHIA DE SEGUROS, S.A.

R. Castilho, 233-7º 1099-004 Lisboa

M.C.R.C. e Pessoa Colectiva N.º 504405489

Fundo de Pensões Aberto CA Reforma Mais

31 de Dezembro de 2018

Valor da Unidade de Participação: 7,09698

N.º de Unidades de Participação: 1 465 214,12875

Composição da Carteira em 31 de Dezembro de 2018

	Designação	Quantidade	Moeda	Cotação/ Preço Unit. em Euros	VALOR	Juros Decorridos (em Euros)	Montante Global (em Euros)
1	VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS	5702195		0	7 284 028,48	32 716,46	7 316 744,94
1.1	Mercado de cotações oficiais de bolsa de valores portuguesa e outros mercado	1347000		0	1 357 953,53	16 992,86	1 374 946,39
1.1.1	Títulos de dívida pública	1347000		0	1 357 953,53	16 992,86	1 374 946,39
1.1.1	PGB 2.125% 17/10/28	397000	EUR	103,599	411 288,03	1 733,48	413 021,51
1.1.1	PGB 2.25% 18/04/34	950000	EUR	99,649	946 665,50	15 259,38	961 924,88
1.2	Mercado de cotações oficiais de bolsa valores de outros Estados-membro da Un	4255195		0	5 827 263,45	15 683,55	5 842 947,00
1.2.1	Títulos de dívida pública	1898000		0	1 847 451,29	7 185,77	1 854 637,06
1.2.1	BTPS 0.95% 01/03/23	413000	EUR	97,49	402 633,70	1 300,67	403 934,37
1.2.1	BTPS 2% 01/02/28	419000	EUR	95,68	400 899,20	3 489,75	404 388,95
1.2.1	BTPS 2.8% 01/12/28	408000	EUR	100,658	410 684,64	938,96	411 623,60
1.2.1	CCTS Float 15/09/25	375000	EUR	89,913	337 173,75	308,91	337 482,66
1.2.1	PGB Float 02/08/22	123000	EUR	104,55	128 596,50	687,20	129 283,70
1.2.1	PGB Float 12/04/22	116000	EUR	105,26	122 101,60	420,69	122 522,29
1.2.1	PGB Float 30/11/21	5000	EUR	105,32	5 266,00	8,61	5 274,61
1.2.1	PGB Floater 05/12/22	39000	EUR	102,81	40 095,90	30,98	40 126,88
1.2.3	Obrigações diversas	2150000		0	2 135 073,50	8 497,78	2 143 571,28
1.2.3	ACAAP 4.5% 29/09/21	100000	EUR	111,498	111 498,00	24,66	111 522,66
1.2.3	ACAAP Float 06/03/26	100000	EUR	97,044	97 044,00	19,72	97 063,72
1.2.3	AMSSM Float 18/03/22	100000	EUR	98,908	98 908,00	5,02	98 913,02
1.2.3	BACRED Float 18/05/22	100000	EUR	95,204	95 204,00	57,81	95 261,81
1.2.3	BKIR 4.25% 11/06/24 - 19	100000	EUR	100,328	100 328,00	2 363,70	102 691,70
1.2.3	CABKSM 1.125% 12/01/23	100000	EUR	97,89	97 890,00	1 088,01	98 978,01
1.2.3	CAFP Float 15/06/22	100000	EUR	98,718	98 718,00	13,73	98 731,73
1.2.3	CS Float 20/12/22	100000	EUR	100,3635	100 363,50	37,25	100 400,75
1.2.3	DANBNK 0.875% 22/05/23	150000	EUR	96,395	144 592,50	801,88	145 394,38
1.2.3	DECFP Float 24/10/20	100000	EUR	99,781	99 781,00	2,46	99 783,46
1.2.3	DT Float 01/12/22	100000	EUR	99,342	99 342,00	2,64	99 344,64
1.2.3	EDPPL 0% 12/11/23	100000	EUR	91,0245	91 024,50	0,00	91 024,50
1.2.3	FERROV 3.5% 13/12/21	100000	EUR	105,647	105 647,00	172,60	105 819,60
1.2.3	FIAT 4.75 22/03/21	100000	EUR	106,606	106 606,00	3 695,89	110 301,89
1.2.3	GS Float 26/09/23-22	100000	EUR	95,29	95 290,00	4,32	95 294,32
1.2.3	HSBC Float 04/12/21-20	100000	EUR	99,921	99 921,00	43,80	99 964,80
1.2.3	INTNED Float 26/11/21	100000	EUR	100,035	100 035,00	10,11	100 045,11
1.2.3	ISPIM Float 28/02/21	100000	EUR	98,911	98 911,00	68,73	98 979,73
1.2.3	MS Float 08/11/22	100000	EUR	98,672	98 672,00	56,39	98 728,39
1.2.3	SANTAN Float 21/03/22	100000	EUR	99,07	99 070,00	19,75	99 089,75
1.2.3	SOCGEN Float 06/03/23	100000	EUR	96,228	96 228,00	9,31	96 237,31
1.2.6	Unidades de participação de fundos de investimento fechados	207195		0	1 844 738,66	0,00	1 844 738,66
1.2.6	ComStage ETF PSI 20	120700	EUR	5,369	648 038,30	0,00	648 038,30
1.2.6	DB X-Trackers-MSCI World TRN Index ETF	2030	EUR	46,52	94 435,60	0,00	94 435,60
1.2.6	Ishares Euro Stoxx 50 UCITS ETF	17545	EUR	29,9550003	525 560,48	0,00	525 560,48
1.2.6	Ishares Euro Stoxx Banks 30-15 ETF	56220	EUR	8,464	475 846,08	0,00	475 846,08
1.2.6	Lyxor MSCI Emerging Markets-A	10700	EUR	9,426	100 858,20	0,00	100 858,20
1.3	Mercado de cotações oficiais de bolsas de Estado não membro da União Europei	100000		0	98 811,50	40,05	98 851,55
1.3.3	Obrigações diversas	100000		0	98 811,50	40,05	98 851,55
1.3.3	T Float 05/09/23	100000	EUR	98,8115	98 811,50	40,05	98 851,55
3	UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO DE INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTO COLECTIVO	109742,7735		0	2 804 980,19	0,00	2 804 980,19
3.1	Fundos harmonizados	109742,7735		0	2 804 980,19	0,00	2 804 980,19
3.1	Allianz Global Equity-IT	9699,321	EUR	16,1900003	157 032,01	0,00	157 032,01
3.1	Allianz RCM Europe Equity Growth-IT	102,337	EUR	2543,12995	260 256,29	0,00	260 256,29
3.1	Allianz RCM Global Agricultural Trend	555,96	EUR	108,919994	60 555,16	0,00	60 555,16
3.1	CA Acções Europa (UP)	36743,68981	EUR	3,78660011	139 133,66	0,00	139 133,66
3.1	CA Rendimento (UP)	14141,46162	EUR	7,54890003	106 752,48	0,00	106 752,48
3.1	Candriam Equities L Europe OPT5	1667,45	EUR	160,209997	267 142,16	0,00	267 142,16
3.1	DNCA Invest Miuri	407,1922	EUR	118,400009	48 211,56	0,00	48 211,56
3.1	Fidelity Funds-European Dynamic Growth Fund-Y ACC	10356,2	EUR	18,7699996	194 385,87	0,00	194 385,87
3.1	Fidelity Funds-World Fund A	8765,45	EUR	20,6800005	181 269,51	0,00	181 269,51
3.1	H2O ADAGIO-IC	0,5689	EUR	71813,9216	40 854,94	0,00	40 854,94
3.1	Invesco Global Targeted Returns Eur	2047,59	EUR	10,6707007	21 849,22	0,00	21 849,22
3.1	JPMorgan Funds-Europe Strategic Growth -A-A	9275,58	EUR	24,9100002	231 054,70	0,00	231 054,70
3.1	LM-WA Macro Oppport BD	450,572	EUR	113,609989	51 189,48	0,00	51 189,48
3.1	Legg Mason AF - EnTrustPermal Alternative Inc Strategy	981,643	EUR	97,9000003	96 102,85	0,00	96 102,85
3.1	Lyxor Core EURSTX 600 DR	1750	EUR	134,68	235 690,00	0,00	235 690,00
3.1	Lyxor ETF S&P 500	11342	EUR	22,2880004	252 790,50	0,00	252 790,50
3.1	Natix AM FDS-Seeyond MINV-IA	12,1121	EUR	18249,4704	221 039,41	0,00	221 039,41
3.1	Nordea 1 SICAV-Flexible Fixed Income Fund	249,468	EUR	107,860006	26 907,62	0,00	26 907,62
3.1	Pictet - Europe Index-PC	0,14824	EUR	167,768484	24,87	0,00	24,87
3.1	Pictet - Global Megatrend Selection-I	704,85264	EUR	227,529998	160 375,12	0,00	160 375,12
3.1	Pictet Multi Asset Global Opportunities	233,82697	EUR	118,730016	27 762,28	0,00	27 762,28
3.1	Schroder ISF - European Alpha Absolute Return B	255,35	EUR	96,3403172	24 600,50	0,00	24 600,50
4	IMOBILIÁRIO	3492		0	58 284,27	0,00	58 284,27
4.2	Unidades de participação de fundos de investimento imobiliário	3492		0	58 284,27	0,00	58 284,27
4.2	CA Património Crescente	3492	EUR	16,690799	58 284,27	0,00	58 284,27
5	LIQUIDEZ	0		0	218 587,03	0,00	218 587,03
5.1	À vista	0		0	254 481,82	0,00	254 481,82
5.1.2	Depósitos à ordem	0		0	254 481,82	0,00	254 481,82
5.1.2	EUR - CCCAM	0	EUR	0	76 880,61	0,00	76 880,61
5.1.2	EUR - FUTUROS - ALTURA	0	EUR	0	132 090,45	0,00	132 090,45
5.1.2	EUR - FUTUROS - CMG ALTURA	0	EUR	0	45 510,76	0,00	45 510,76
5.3	Devedores e Credores	0		0	-35 894,79	0,00	-35 894,79
5.3.1	Operações a Liquidar	0		0	-0,05	0,00	-0,05
5.3.1	Diferimento do Juro das OPLs	0	EUR	0	-0,05	0,00	-0,05
5.3.2	Impostos	0		0	-1 419,30	0,00	-1 419,30
5.3.2	FP - IRS - Cat E	0	EUR	0	-40,35	0,00	-40,35

CRÉDITO AGRÍCOLA VIDA - COMPANHIA DE SEGUROS, S.A.

R. Castilho, 233 - 7º 1099-004 Lisboa

M.C.R.C. e Pessoa Colectiva N.º 504405489

Fundo de Pensões Aberto CA Reforma Mais**31 de Dezembro de 2018**

Valor da Unidade de Participação: 7,09698

N.º de Unidades de Participação: 1 465 214,12875

Composição da Carteira em 31 de Dezembro de 2018

Designação	Quantidade	Moeda	Cotação/ Preço Unit. em Euros	VALOR	Juros Decorridos (em Euros)	Montante Global (em Euros)
5.3.2 Imposto de Selo - FP - CD	0	EUR	0	-82,90	0,00	-82,90
5.3.2 Imposto do Selo - FP CG	0	EUR	0	-1 296,05	0,00	-1 296,05
5.3.3 Comissões	0		0	-34 475,44	0,00	-34 475,44
5.3.3 FP - Comissão de Depósito	0	EUR	0	-2 073,65	0,00	-2 073,65
5.3.3 FP - Comissão de Gestão	0	EUR	0	-32 401,79	0,00	-32 401,79
7 OPERAÇÕES COM PRODUTOS DERIVADOS	-22		0	0,00	0,00	0,00
7.1 Em mercado regulamentado	-22		0	0,00	0,00	0,00
7.1.1 Futuros	-22		0	0,00	0,00	0,00
7.1.1 EURO BOBL FUTURE - MAR 19 (FGBM-ALTURA)	-6	EUR	132,52	0,00	0,00	0,00
7.1.1 EURO-BUND Future MAR 19 (FGBL-ALTURA)	-6	EUR	163,54	0,00	0,00	0,00
TOTAL				10 385 879,97	32 716,46	10 398 596,43