

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

R. Castilho, 233 - 7ª 1099-004 Lisboa

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

Fundo de Pensões Aberto CA Reforma Segura

31 de Dezembro de 2018

Valor da Unidade de Participação: 5,84710

N.º de Unidades de Participação: 4 723 782,06154

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	23 882 500		0,00	23 805 449,52	123 000,26	23 928 449,78
1.1 Mercado de cotações oficiais de bolsa de valores portuguesa e outros mercado	4 574 500		0,00	4 630 378,13	53 398,96	4 683 777,09
1.1.1 Títulos de dívida pública	4 174 500		0,00	4 221 782,13	49 694,85	4 271 476,98
1.1.1 AZORES 1.85% 21/08/25	437 500	EUR	103,54	452 987,50	2 967,71	455 955,21
1.1.1 PGB 2.125% 17/10/28	1 137 000	EUR	103,60	1 177 920,63	4 964,64	1 182 885,27
1.1.1 PGB 2.25% 18/04/34	2 600 000	EUR	99,65	2 590 874,00	41 762,50	2 632 636,50
1.1.3 Obrigações diversas	400 000		0,00	408 596,00	3 704,11	412 300,11
1.1.3 CXGD 1% 27/01/22	400 000	EUR	102,15	408 596,00	3 704,11	412 300,11
1.2 Mercado de cotações oficiais de bolsa valores de outros Estados-membro da Un	19 108 000		0,00	18 977 448,39	69 521,20	19 046 969,59
1.2.1 Títulos de dívida pública	6 028 000		0,00	5 872 731,44	23 848,13	5 896 579,57
1.2.1 BTPS 0.95% 01/03/23	1 500 000	EUR	97,49	1 462 350,00	4 723,97	1 467 073,97
1.2.1 BTPS 2% 01/02/28	1 494 000	EUR	95,68	1 429 459,20	12 443,18	1 441 902,38
1.2.1 BTPS 2.8% 01/12/28	1 383 000	EUR	100,66	1 392 100,14	3 182,79	1 395 282,93
1.2.1 CCTS Float 15/09/25	910 000	EUR	89,91	818 208,30	749,62	818 957,92
1.2.1 PGB Float 02/08/22	419 000	EUR	104,55	438 064,50	2 340,95	440 405,45
1.2.1 PGB Float 12/04/22	50 000	EUR	105,26	52 630,00	161,33	52 811,33
1.2.1 PGB Float 30/11/21	11 000	EUR	105,32	11 585,20	18,94	11 604,14
1.2.1 PGB Floater 05/12/22	261 000	EUR	102,81	268 334,10	207,35	268 541,45
1.2.3 Obrigações diversas	13 080 000		0,00	13 104 716,95	45 673,07	13 150 390,02
1.2.3 ABNAV Float 03/12/21	100 000	EUR	100,01	100 014,00	6,53	100 020,53
1.2.3 ACAFP 4.5% 29/09/21	550 000	EUR	111,50	613 239,00	135,62	613 374,62
1.2.3 AMSSM Float 18/03/22	400 000	EUR	98,91	395 632,00	20,08	395 652,08
1.2.3 BAC Float 25/04/24	200 000	EUR	96,96	193 924,00	142,19	194 066,19
1.2.3 BACRED Float 18/05/22	300 000	EUR	95,20	285 612,00	173,43	285 785,43
1.2.3 BAYNGR Float 26/06/22	300 000	EUR	99,23	297 675,00	10,00	297 685,00
1.2.3 BCPPL 0.75% 31/05/22	300 000	EUR	101,02	303 060,00	1 319,18	304 379,18
1.2.3 BFCM 0.5% 16/11/22	200 000	EUR	99,64	199 272,00	123,29	199 395,29
1.2.3 BKIR 4.25% 11/06/24 - 19	200 000	EUR	100,33	200 656,00	4 727,40	205 383,40
1.2.3 BNP Float 07/06/24	200 000	EUR	96,41	192 826,00	57,87	192 883,87
1.2.3 BNP Float 22/09/22	150 000	EUR	98,99	148 483,50	20,25	148 503,75
1.2.3 BPCEGP Float 09/03/22	300 000	EUR	99,69	299 067,00	134,75	299 201,75
1.2.3 BWA 1.8% 07/11/22	300 000	EUR	102,12	306 354,00	798,90	307 152,90
1.2.3 CABKSM 1.125% 12/01/23	200 000	EUR	97,89	195 780,00	2 176,03	197 956,03
1.2.3 CAFF Float 15/06/22	300 000	EUR	98,72	296 154,00	41,20	296 195,20
1.2.3 CCL 1.875% 11/07/22	400 000	EUR	104,13	416 536,00	1 109,59	417 645,59
1.2.3 CS Float 20/12/22	300 000	EUR	100,36	301 090,50	111,74	301 202,24
1.2.3 DANBNK 0.875% 22/05/23	370 000	EUR	96,40	356 681,50	1 977,98	358 659,48
1.2.3 DECFP Float 24/10/20	100 000	EUR	99,78	99 781,00	2,46	99 783,46
1.2.3 DT Float 01/12/22	350 000	EUR	99,34	347 697,00	9,26	347 706,26
1.2.3 EDPLP 0% 12/11/23	250 000	EUR	91,02	227 561,25	0,00	227 561,25
1.2.3 EXPE 2.5% 03/06/22	200 000	EUR	103,15	206 300,00	2 890,41	209 190,41
1.2.3 F Float 01/12/21	300 000	EUR	92,94	278 808,00	13,50	278 821,50
1.2.3 FERROV 3.5% 13/12/21	200 000	EUR	105,65	211 294,00	345,21	211 639,21
1.2.3 FIAT 4.75 22/03/21	230 000	EUR	106,61	245 193,80	8 500,55	253 694,35
1.2.3 GM Float 10/05/21	150 000	EUR	97,21	145 810,50	76,29	145 886,79
1.2.3 GS Float 26/09/23-22	300 000	EUR	95,29	285 870,00	12,96	285 882,96
1.2.3 HAR 2% 27/05/22	350 000	EUR	104,01	364 038,50	4 142,47	368 180,97
1.2.3 HSBC Float 04/12/21-20	200 000	EUR	99,92	199 842,00	87,60	199 929,60
1.2.3 HSBC Float 05/10/23-22	300 000	EUR	95,78	287 346,00	131,95	287 477,95
1.2.3 INTNED Float 26/11/21	300 000	EUR	100,04	300 105,00	30,33	300 135,33
1.2.3 ISPM Float 28/02/21	170 000	EUR	98,91	168 148,70	116,85	168 265,55
1.2.3 JPM 3.875% 23/09/20	200 000	EUR	106,40	212 790,00	2 102,05	214 892,05
1.2.3 MLFP 1.125% 28/05/22	500 000	EUR	102,43	512 155,00	3 344,18	515 499,18
1.2.3 MS Float 08/11/22	300 000	EUR	98,67	296 016,00	169,16	296 185,16
1.2.3 NDAQ 1.75% 19/05/23	100 000	EUR	103,47	103 473,00	1 083,56	104 556,56
1.2.3 NEXLN Float 15/05/20	300 000	EUR	99,30	297 900,00	32,20	297 932,20
1.2.3 NOSPL 1.125% 02/05/23	200 000	EUR	99,385	198 770,00	1 497,94	200 267,94
1.2.3 PKOBP 0.75% 25/07/21	400 000	EUR	100,063	400 252,00	1 306,85	401 558,85
1.2.3 RABOBK Float 27/04/21	600 000	EUR	106,2195	637 317,00	3 360,00	640 677,00
1.2.3 RBS Float 27/09/21	360 000	EUR	98,5470	354 769,20	23,64	354 792,84
1.2.3 SANTAN Float 21/03/22	300 000	EUR	99,0700	297 210,00	59,25	297 269,25
1.2.3 SCANIA Float 17/03/21	200 000	EUR	99,528	199 056,00	10,81	199 066,81
1.2.3 SOCGEN Float 06/03/23	200 000	EUR	96,228	192 456,00	18,61	192 474,61
1.2.3 UBS Float 20/09/22-21	500 000	EUR	99,1190	495 595,00	59,43	495 654,43
1.2.3 UCGIM 2 30/06/23	250 000	EUR	93,879	234 697,50	2,65	234 700,15
1.2.3 UCGIM 3.25% 14/01/21	100 000	EUR	104,195	104 195,00	3 125,34	107 320,34
1.2.3 VW Float 06/07/21	100 000	EUR	98,233	98 233,00	31,53	98 264,53
1.3 Mercado de cotações oficiais de bolsas de Estado não membro da União Europei	200 000		0	197 623,00	80,10	197 703,10
1.3.3 Obrigações diversas	200 000		0	197 623,00	80,10	197 703,10
1.3.3 T Float 05/09/23	200 000	EUR	98,8115	197 623,00	80,10	197 703,10
3 UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO DE INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTO COLECTIVO	45 646		0	1 413 231,48	0,00	1 413 231,48
3.1 Fundos harmonizados	45 396		0	1 166 131,48	0,00	1 166 131,48
3.1 Amundi Funds - Absolute Forex	123	EUR	1028,310012	126 178,78	0,00	126 178,78
3.1 CA Rendimento (UP)	40 093	EUR	7,548900102	302 658,56	0,00	302 658,56
3.1 Candriam Long Short Credit	69	EUR	1153,429934	79 561,29	0,00	79 561,29
3.1 H2O ADAGIO-IC	2	EUR	71813,9216	122 564,82	0,00	122 564,82
3.1 LM-WA Macro Opport BD	1 139	EUR	113,610001	129 434,17	0,00	129 434,17
3.1 Legg Mason AF - EnTrustPermat Alternative Inc Strategy	2 258	EUR	97,89999911	221 036,66	0,00	221 036,66
3.1 Nordea 1 SICAV-Flexible Fixed Income Fund	1 712	EUR	107,8600006	184 697,20	0,00	184 697,20
3.2 Fundos não harmonizados	250		0	247 100,00	0,00	247 100,00
3.2 Fundo Energia FCR - CAT B	250	EUR	988,4	247 100,00	0,00	247 100,00
4 IMOBILIÁRIO	11 423		0	190 659,01	0,00	190 659,01
4.2 Unidades de participação de fundos de investimento imobiliário	11 423		0	190 659,01	0,00	190 659,01
4.2 CA Património Crescente	11 423	EUR	16,69080014	190 659,01	0,00	190 659,01
5 LIQUIDEZ	0		0	2 088 077,50	0,00	2 088 077,50
5.1 À vista	0		0	2 576 788,32	0,00	2 576 788,32
5.1.2 Depósitos à ordem	0		0	2 576 788,32	0,00	2 576 788,32
5.1.2 EUR - CCCAM	0	EUR	0	2 354 083,82	0,00	2 354 083,82
5.1.2 EUR - FUTUROS - ALTURA	0	EUR	0	66 544,48	0,00	66 544,48
5.1.2 EUR - FUTUROS - CMG ALTURA	0	EUR	0	156 160,02	0,00	156 160,02
5.3 Devedores e Credores	0		0	-488 710,82	0,00	-488 710,82
5.3.1 Operações a Liquidar	0		0	-394 517,53	0,00	-394 517,53
5.3.1 Diferimento do Juro das OPLs	0	EUR	0	9,22	0,00	9,22
5.3.1 Liquidação Parcial Operações	0	EUR	0	-240 000,00	0,00	-240 000,00
5.3.1 OPL - Obrigações - Compra (Bolsa)	0	EUR	0	-154 526,75	0,00	-154 526,75
5.3.2 Impostos	0		0	-3 662,10	0,00	-3 662,10
5.3.2 FP - IRS - Cat E	0	EUR	0	-40,90	0,00	-40,90
5.3.2 Imposto de Selo - FP - CD	0	EUR	0	-217,84	0,00	-217,84

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 Segura

31 de Dezembro de 2018

Valor da Unidade de Participação: 5,84710

N.º de Unidades de Participação: 4 723 782,06154

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 do Selo - FP CG	0	EUR	0	-3 403,36	0,00	-3 403,36
5.3.3	Comissões	0		0	-90 531,19	0,00	-90 531,19
5.3.3	FP - Comissão de Depósito	0	EUR	0	-5 445,57	0,00	-5 445,57
5.3.3	FP - Comissão de Gestão	0	EUR	0	-85 085,62	0,00	-85 085,62
7	OPERAÇÕES COM PRODUTOS DERIVADOS	-84		0	0,00	0,00	0,00
7.1	Em mercado regulamentado	-84		0	0,00	0,00	0,00
7.1.1	Futuros	-84		0	0,00	0,00	0,00
7.1.1	EURO BOBL FUTURE - MAR 19 (FGBM-ALTURA)	-35	EUR	132,52	0,00	0,00	0,00
7.1.1	EURO-BUND Future MAR 19 (FGBL-ALTURA)	-49	EUR	163,54	0,00	0,00	0,00
TOTAL			EUR		27 497 417,51	123 000,26	27 620 417,77