

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

R. Castilho, 233 - 7º 1099-004 Lisboa

M.C.R.C. e Pessoa Colectiva Nº 504405489

Fundo de Pensões Aberto CA Reforma Segura

31 de Dezembro de 2017

Valor da Unidade de Participação: 6,01050

Nº de Unidades de Participação: 3 782 685,83391

Composição da Carteira em 31 de Dezembro de 2017

Designação		Quantidade	Moeda	Cotação/ Preço Unit. em Euros	VALOR	Juros Decorridos (em Euros)	Montante Global (em Euros)
1	VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS	19.424.000		0,00	20.263.749,01	121.164,82	20.384.913,83
1.1	Mercado de cotações oficiais de bolsa de valores portuguesa e outros mercado	1.346.000		0,00	1.671.037,06	61.891,08	1.732.928,14
1.1.1	Títulos de dívida pública	1.346.000		0,00	1.671.037,06	61.891,08	1.732.928,14
1.1.1.1	PGB 4.125% 14/04/27	450.000	EUR	118,35	532.570,50	17.647,09	550.217,59
1.1.1.1	PGB 5.65% 15/02/24	896.000	EUR	127,06	1.138.466,56	44.243,99	1.182.710,55
1.2	Mercado de cotações oficiais de bolsa valores de outros Estados-membro da Un	18.078.000		0,00	18.592.711,95	59.273,74	18.651.985,69
1.2.1	Títulos de dívida pública	6.208.000		0,00	6.454.857,85	28.128,72	6.482.986,57
1.2.1.1	BGB 0.8% 22/06/25	284.000	EUR	103,42	293.715,64	1.195,13	294.910,77
1.2.1.1	BTPS 0.9% 01/08/22	1.766.000	EUR	100,69	1.778.114,76	6.618,87	1.784.733,63
1.2.1.1	BTPS 4.50% 01/03/24	371.000	EUR	119,26	442.454,60	5.580,37	448.034,97
1.2.1.1	CCTS Float 15/06/22	200.000	EUR	100,96	201.920,00	24,62	201.944,62
1.2.1.1	FRTR 0.25% 25/11/26	660.000	EUR	97,46	643.229,40	162,74	643.392,14
1.2.1.1	FRTR 1% 25/05/27	406.000	EUR	103,31	419.430,48	2.447,12	421.877,60
1.2.1.1	FRTR 2.25% 25/05/24	618.000	EUR	113,56	701.813,16	8.381,10	710.194,26
1.2.1.1	NETHER 0.5% 15/07/26	236.000	EUR	101,06	238.508,68	546,36	239.055,04
1.2.1.1	PGB Float 02/08/22	180.000	EUR	105,66	190.188,00	1.208,00	191.396,00
1.2.1.1	PGB Float 30/11/21	170.000	EUR	106,51	181.058,50	292,78	181.351,28
1.2.1.1	PGB Floater 05/12/22	590.000	EUR	103,37	609.883,00	468,72	610.351,72
1.2.1.1	RAGB 1.65% 21/10/24	267.000	EUR	109,87	293.350,23	856,96	294.207,19
1.2.1.1	SPGB 0.45% 31/10/22	460.000	EUR	100,26	461.191,40	345,95	461.537,35
1.2.3	Obrigações diversas	11.870.000		0,00	12.137.854,10	31.145,02	12.168.999,12
1.2.3	ACAFF 4.5% 29/09/21	300.000	EUR	115,36	346.086,00	73,97	346.159,97
1.2.3	BAC Float 04/05/23	500.000	EUR	101,79	508.945,00	357,04	509.302,04
1.2.3	BACRED Float 18/05/22	300.000	EUR	101,79	305.379,00	168,77	305.547,77
1.2.3	BBVASM Float 12/04/22	200.000	EUR	101,17	202.344,00	120,44	202.464,44
1.2.3	BCPPL 0.75% 31/05/22	200.000	EUR	101,18	202.360,00	879,45	203.239,45
1.2.3	BNP Float 22/09/22	150.000	EUR	102,55	153.826,50	19,54	153.846,04
1.2.3	BPCEGP Float 09/03/22	200.000	EUR	103,11	206.212,00	88,61	206.300,61
1.2.3	CASHSM 1.375% 04/02/26	500.000	EUR	98,08	490.385,00	508,56	490.893,56
1.2.3	CCBGBB 0.75% 12/09/22	200.000	EUR	100,14	200.286,00	452,05	200.738,05
1.2.3	CMZB Float 08/03/22	100.000	EUR	101,71	101.713,00	27,09	101.740,09
1.2.3	CS Float 20/12/22	500.000	EUR	104,83	524.147,50	183,49	524.330,99
1.2.3	DAIGR Float 03/07/24	600.000	EUR	100,68	604.086,00	179,48	604.265,48
1.2.3	F Float 01/12/21	300.000	EUR	100,04	300.132,00	10,25	300.142,25
1.2.3	FCABNK 1% 15/11/21	300.000	EUR	102,16	306.486,00	378,08	306.864,08
1.2.3	FERROV Float 18/07/22	200.000	EUR	100,72	201.431,00	393,79	201.824,79
1.2.3	GALPNA 1.375% 19/09/23	100.000	EUR	102,71	102.714,00	388,01	103.102,01
1.2.3	GM Float 10/05/21	150.000	EUR	100,82	151.228,50	73,57	151.302,07
1.2.3	GS Float 26/09/23-22	500.000	EUR	100,49	502.470,00	16,17	502.486,17
1.2.3	HAR 2% 27/05/22	500.000	EUR	105,49	527.425,00	5.972,60	533.397,60
1.2.3	HSBC Float 05/10/23-22	300.000	EUR	100,67	302.010,00	123,25	302.133,25
1.2.3	ISPIM Float 28/02/21	170.000	EUR	102,15	173.660,10	113,27	173.773,37
1.2.3	KHC 2% 30/06/23	300.000	EUR	105,56	316.680,00	3.024,66	319.704,66
1.2.3	LPTY Float 04/11/20	100.000	EUR	100,59	100.588,00	30,24	100.618,24
1.2.3	Lloyds Float 21/06/24	300.000	EUR	102,30	306.888,00	37,58	306.925,58
1.2.3	MAERSK 1.5% 24/11/22	300.000	EUR	103,85	311.547,00	456,16	312.003,16
1.2.3	NDAQ 1.75% 19/05/23	100.000	EUR	104,57	104.571,00	1.083,56	105.654,56
1.2.3	NEXLN Float 15/05/20	300.000	EUR	100,07	300.210,00	27,22	300.237,22
1.2.3	PSABFR 0.625% 10/10/22	250.000	EUR	99,86	249.637,50	351,03	249.988,53
1.2.3	RABOBK Float 27/04/21	600.000	EUR	109,33	655.980,00	3.360,00	659.340,00
1.2.3	RCFFP 1.5% 03/04/24	500.000	EUR	101,10	505.495,00	5.589,04	511.084,04
1.2.3	RENAUL Float 04/11/24	300.000	EUR	100,59	301.770,00	117,51	301.887,51
1.2.3	SABSM 0.875% 05/03/23	400.000	EUR	98,99	395.976,00	249,32	396.225,32
1.2.3	SANTAN Float 28/03/23	300.000	EUR	100,63	301.875,00	10,52	301.885,52
1.2.3	SCBGER 0.75% 17/10/22	200.000	EUR	100,09	200.172,00	308,22	200.480,22
1.2.3	SECUSS 1.125% 20/02/24 - 23	400.000	EUR	100,50	401.980,00	3.871,23	405.851,23
1.2.3	SOCGEN Float 01/04/22	300.000	EUR	102,222	306.666,00	395,09	307.061,09
1.2.3	T Float 04/09/23	400.000	EUR	101,6	406.400,00	156,30	406.556,30
1.2.3	TWX 1.95% 15/09/23	100.000	EUR	105,5250	105.525,00	571,64	106.096,64
1.2.3	VW 1.125% 04/04/24	350.000	EUR	100,6680	352.338,00	949,31	353.287,31
1.2.3	VW Float 06/07/21	100.000	EUR	100,2290	100.229,00	28,91	100.257,91
3	UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO DE INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTO COLECTIVO	43.368		0	879.964,09	0,00	879.964,09
3.1	Fundos harmonizados	43.368		0	879.964,09	0,00	879.964,09
3.1	Amundi Funds - Absolute Forex	123	EUR	1070,0500	131.300,49	0,00	131.300,49
3.1	CA Rendimento (UP)	40.093	EUR	7,781399899	311.980,19	0,00	311.980,19
3.1	Candriam Long Short Credit	69	EUR	1167,249993	80.514,57	0,00	80.514,57
3.1	LM-WA Macro Opport BD	1.371	EUR	123,7300016	169.639,40	0,00	169.639,40
3.1	Nordea 1 SICAV-Flexible Fixed Income Fund	1.712	EUR	108,9299974	186.529,44	0,00	186.529,44
4	IMOBILIÁRIO	11.423		0	181.118,52	0,00	181.118,52
4.2	Unidades de participação de fundos de investimento imobiliário	11.423		0	181.118,52	0,00	181.118,52
4.2	CA Património Crescente	11.423	EUR	15,85560011	181.118,52	0,00	181.118,52
5	LIQUIDEZ	0		0	1.289.838,16	0,00	1.289.838,16
5.1	À vista	0		0	1.451.405,28	0,00	1.451.405,28
5.1.2	Depósitos à ordem	0		0	1.451.405,28	0,00	1.451.405,28
5.1.2	EUR - CCCAM	0	EUR	0	1.290.428,88	0,00	1.290.428,88
5.1.2	EUR - FUTUROS - ALTURA	0	EUR	0	160.976,40	0,00	160.976,40
5.3	Devedores e Credores	0		0	-161.567,12	0,00	-161.567,12
5.3.1	Operações a Liquidar	0		0	-84.584,09	0,00	-84.584,09
5.3.1	Diferimento do Juro das OPLs	0	EUR	0	9,39	0,00	9,39
5.3.1	OPL - Obrigações - Compra (Bolsa)	0	EUR	0	-84.754,13	0,00	-84.754,13
5.3.1	OPL - Obrigações - Compra (Fora de Bolsa) - Juro Bruto	0	EUR	0	-2.158.697,60	0,00	-2.158.697,60
5.3.1	OPL - Obrigações - Venda (Fora de Bolsa) - Juro Bruto	0	EUR	0	2.158.858,25	0,00	2.158.858,25
5.3.2	Impostos	0		0	-2.996,24	0,00	-2.996,24
5.3.2	FP - IRS - Cat E	0	EUR	0	-36,86	0,00	-36,86
5.3.2	Imposto de Selo - FP - CD	0	EUR	0	-177,91	0,00	-177,91
5.3.2	Imposto do Selo - FP CG	0	EUR	0	-2.781,47	0,00	-2.781,47
5.3.3	Comissões	0		0	-73.986,79	0,00	-73.986,79
5.3.3	FP - Comissão de Depósito	0	EUR	0	-4.450,27	0,00	-4.450,27
5.3.3	FP - Comissão de Gestão	0	EUR	0	-69.536,52	0,00	-69.536,52
	TOTAL		EUR		22.614.669,78	121.164,82	22.735.834,60