

## CAIXA JUNHO 2018 II ICAE

31 Dezembro 2017

O produto Caixa Junho 2018 II teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 03/12/2012 e 21/12/2012. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31/12/2017, sendo que as valorizações utilizadas correspondem às cotações disponíveis no último dia útil do exercício.

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>924.657,95</b>	<b>46.591.045,96</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>922.470,21</b>	<b>39.724.808,78</b>	<b>85,3%</b>
<b>1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal</b>					<b>922.470,21</b>	<b>39.724.808,78</b>	<b>85,3%</b>
<b>1.1.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>922.470,21</b>	<b>39.724.808,78</b>	<b>85,3%</b>
PGB, 4.45%, 15/06/2018, GOVT	38.021.752,00	102,05%	EUR	102,05%	922.470,21	39.724.808,78	85,3%
<b>5. Liquidez</b>						<b>6.875.088,20</b>	<b>14,8%</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>1.950.484,46</b>	<b>4,2%</b>
Depósitos à Ordem						1.950.484,46	4,2%
<b>5.2. A Prazo</b>					<b>2.187,74</b>	<b>4.924.603,74</b>	<b>10,6%</b>
Depósitos e Outros Equiparados					2.187,74	4.924.603,74	10,6%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-8.851,02</b>	<b>0,0%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-8.851,02</b>	<b>0,0%</b>
Comissões						-8.851,02	0,0%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

46.591.045,96

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

358.958,60

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

129,79504

O património do Fundo será representado inicialmente por 15% em Obrigações ou Depósitos da Caixa Geral de Depósitos, S.A. e o restante por Títulos de Dívida Pública Portuguesa, cujas notações de *rating* na data de subscrição do contrato, são, respetivamente, de BB- / Ba3 (*Standard & Poor's / Moody's*) e BB / Ba3 (*Standard & Poor's / Moody's*). O remanescente, se o houver, será representado por depósitos ou outros instrumentos de dívida de curto prazo, nomeadamente Bilhetes do Tesouro, Certificados de Depósito e depósitos denominados em euros. Contudo, poderão existir momentos em que os mercados financeiros se apresentem menos líquidos e em que simultaneamente exista maior volume de pedidos de resgate das unidades de participação. Nestas circunstâncias a Companhia, prevendo as necessidades de liquidez e para ser eficiente no preço de transação, poderá alienar um maior volume de ativos. Como consequência e para constituição de uma reserva de liquidez, os instrumentos de dívida de curto prazo podem atingir, temporariamente, percentagens superiores 5% do valor do Fundo. Este procedimento será um procedimento de exceção por não ser normal haver fortes afluências aos resgates e por o ativo da carteira ser líquido e facilmente transacionável. Durante a vigência do contrato, o património do fundo poderá passar a ser representado, entre 95% e 100%, por Títulos da Dívida Pública ou Privada de emitentes sedeados em Portugal, com maturidade máxima no ano de 2018 e com notação de *rating* mínima, na data de aquisição, de duas notas abaixo da notação da Dívida Pública Portuguesa.

Junto segue o histórico de rentabilidade e volatilidade deste fundo apurado de acordo com a metodologia definida no Regulamento 2/20012 da CMVM.

<b>Ano</b>	<b>Rendibilidade</b>	<b>Volatilidade</b>	<b>Rend. Anualizada</b>	
<b>2013</b>	8,06%	8,54%	<b>1 Ano</b>	-0,72%
<b>2014</b>	14,59%	4,11%	<b>3 Anos</b>	0,35%
<b>2015</b>	2,15%	2,03%	<b>5 Anos</b>	4,58%
<b>2016</b>	-0,37%	2,10%	<b>Desde o Início</b>	5,34%
<b>2017</b>	-0,72%	0,50%		

As rendibilidades divulgadas representam dados passados, não constituindo garantia de rentabilidade futura.

O produto tem uma volatilidade anual que se situa na classe 2 (Risco Baixo) de volatilidade, conforme quadro anexo.

<b>Classe de Risco</b>	<b>Escalão de Risco</b>	<b>Volatilidade</b>
<b>1</b>	Risco Muito Baixo	< 0,5%
<b>2</b>	Risco Baixo	0,5% - 2%
<b>3</b>	Risco Médio/Baixo	2% - 5%
<b>4</b>	Risco Médio	5% - 10%
<b>5</b>	Risco Médio/Alto	10% - 15%
<b>6</b>	Risco Alto	15% - 25%
<b>7</b>	Risco Muito Alto	>25%