

**CAIXA SEGURO NOSTRUM 12M 2ªS
ICAE**

30 Junho 2016

O produto Caixa Seguro Nostrum – 12 M – 2ª Série teve o início de comercialização em 17/10/2005. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 30/06/2016 sendo que as valorizações utilizadas correspondem às cotações disponíveis no último dia útil do exercício sendo que as valorizações utilizadas correspondem às cotações disponíveis no último dia útil do exercício.

a)

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
Parte I - Valores Patrimoniais						21.308,00	100,0%
5. Liquidez						21.581,86	101,3%
5.1. À Vista						21.581,86	101,3%
Depósitos à Ordem						21.581,86	101,3%
9. Outros Activos						-273,86	-1,3%
9.1. Devedores e Credores Diversos						-273,86	-1,3%
Juros de D.O. a Regularizar						-250,64	-1,2%
Comissões						-23,22	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA
 NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO
 VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

21.308,00
 3.836,752
 5,55366

b)

O Fundo será representado por depósitos bancários efectuados na Caixa Geral de Depósitos, S.A., com uma taxa de rendimento indicativa periódica e antecipadamente divulgada pela Seguradora, podendo ser também representado, acessoriamente, por outros instrumentos monetários de curto prazo, nomeadamente, papel comercial e certificados de depósito. A taxa de rendimento é indicativa, não garantindo a Seguradora um rendimento mínimo.

c)

Junto segue o histórico de rentabilidade e volatilidade deste fundo apurado de acordo com a metodologia definida no Regulamento 8/2007 da CMVM.

Ano	Rendibilidade	Volatilidade	Rend. Anualiz. %	
2006	0,97%	0,02%	1 ano	0,33%
2007	1,14%	0,03%	3 anos	0,45%
2008	1,45%	0,03%	5 anos	0,48%
2009	1,43%	0,09%	Desde o início	1,01%
2010	0,99%	0,34%		
2011	0,39%	0,01%		
2012	0,39%	0,01%		
2013	0,39%	0,01%		
2014	0,39%	0,01%		
2015	0,33%	0,02%		

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

O produto tem uma volatilidade anual que se situa na classe 1 (Risco Baixo), conforme quadro anexo.

De acordo com o nº 2 do artº 12º do Regulamento nº 8/2007 da CMVM:

Desvio-padrão anualizado (%)	Classe de Risco	Escalão de Risco
[0; 1,5]	1	Risco baixo
[1,5; 5]	2	Risco médio baixo
[5; 10]	3	Risco médio
[10; 15]	4	Risco médio alto
[15; 20]	5	Risco alto
>= 20	6	Risco muito alto