

CAIXA SEGURO PPR 8 ANOS ICAE

31 Dezembro 2015

O produto Caixa Seguro PPR 8 ANOS ICAE teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 19-02-2010 e 26-02-2010. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31-12-2015, 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					230.111,57	10.018.506,35	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					230.111,57	9.677.078,86	96,6%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					19.687,71	883.492,89	8,8%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					8.468,37	394.693,37	3,9%
PGB, 4.45%, 15/06/2018, GOVT	350.000,00	110,35%	EUR	110,35%	8.468,37	394.693,37	3,9%
1.1.3. Obrigações Diversas					11.219,34	488.799,52	4,9%
BCP, 4.75%, 22/06/2017, CORP	450.250,00	106,07%	EUR	106,07%	11.219,34	488.799,52	4,9%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					210.423,86	8.793.585,97	87,8%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					84.981,03	3.192.111,34	31,9%
BGB, 4%, 28/03/2017, GOVT	1.161.454,57	105,41%	EUR	105,41%	35.287,91	1.259.577,17	12,6%
NETHERLANDS, 4.5%, 13/11/2017, GOVT	873.585,14	107,44%	EUR	107,44%	18.151,95	956.688,14	9,5%
SPGB, 3.8%, 31/01/2017, GOVT	907.069,65	104,11%	EUR	104,11%	31.541,17	975.846,03	9,7%
1.2.3. Obrigações Diversas					125.442,83	5.601.474,63	55,9%
DEUTSCH BAHN FIN, 4.75%, 14/03/2018, CORP	760.022,75	110,19%	EUR	110,19%	28.801,96	866.301,43	8,6%
DEXIA MUN AGENCY, 4.5%, 13/11/2017, CORP	234.300,00	108,43%	EUR	108,43%	1.382,75	255.422,53	2,5%
ENI, 4.75%, 14/11/2017, CORP	895.000,00	108,09%	EUR	108,09%	5.459,26	972.864,76	9,7%
PROCTER & GAMBLE, 5.125%, 24/10/2017, CORP	687.044,49	109,14%	EUR	109,14%	6.541,94	756.361,69	7,5%
RABOBANK, 4.75%, 15/01/2018, CORP	834.052,82	109,21%	EUR	109,21%	37.989,39	948.883,50	9,5%
ROBERT BOSCH, 5.125%, 12/06/2017, CORP	793.000,00	107,09%	EUR	107,09%	22.430,42	871.685,84	8,7%
SHELL INT FIN, 4.375%, 14/05/2018, CORP	827.050,96	109,68%	EUR	109,68%	22.837,11	929.954,88	9,3%
5. Liquidez					0,00	379.995,50	3,8%
5.1. À Vista					0,00	379.995,50	3,8%
Depósitos à Ordem						379.995,50	3,8%
9. Outros Activos						-38.568,01	-0,4%
9.1. Devedores e Credores Diversos						-38.568,01	-0,4%
Comissões						-38.568,01	-0,4%

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

10.018.506,35
80.764,5817
124,04579

b)

Os activos representativos das Provisões Técnicas dos contratos de seguro desta modalidade são objecto de investimento em Fundo Autónomo.

O património do Fundo será representado, entre 95% e 100%, por obrigações de dívida pública e privada, sénior, emitidas por emittentes da União Europeia, com notações de *rating* mínima de A- (Standard & Poor's) na data de início do presente contrato.

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.

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. %	
2010	1,16%	3,66%	1 ano	0,38%
2011	5,02%	4,67%	3 anos	1,87%
2012	10,65%	3,09%	5 anos	4,20%
2013	1,42%	2,03%	Desde o início	3,76%
2014	3,83%	0,81%		
2015	0,38%	0,47%		

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) de volatilidade, 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