

CAIXA SEGURO 2014 ICAE

30 Junho 2014

O produto Caixa Seguro 2014 teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 16-09-2009 e 02-10-2009. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 30-06-2014, 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 | | | | | 1.890.004,59 | 75.075.983,21 | 100,0% |
| 1. Valores Mobiliários Cotados | | | | | 1.890.004,59 | 75.479.162,28 | 100,5% |
| 1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal | | | | | 1.890.004,59 | 75.479.162,28 | 100,5% |
| 1.1.3. Obrigações Diversas | | | | | 1.890.004,59 | 75.479.162,28 | 100,5% |
| CGD Series 869, 3.511%, 07/10/2014, CORP | 73.684.948,12 | 99,87% | EUR | 99,87% | 1.890.004,59 | 75.479.162,28 | 100,5% |
| 9. Outros Activos | | | | | | -403.179,07 | -0,5% |
| 9.1. Devedores e Credores Diversos | | | | | | -403.179,07 | -0,5% |
| Comissões | | | | | | -403.179,07 | -0,5% |

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

75.075.983,21

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

736.362,7719

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

101,95516

b)

O património do Fundo será representado, entre 95% e 100%, por obrigações sénior, emitidas pela Caixa Geral de Depósitos, S.A., cuja notação de *rating* é de A+ (Standard & Poor's) / Aa1 (Moody'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, acessórios.

Contudo, em períodos de investimento, de reinvestimento ou de grande volume de indemnizações, os instrumentos de dívida de curto prazo poderão atingir, temporariamente, percentagens superiores do valor do Fundo.

c)

Junto segue o histórico de rentabilidade e volatilidade deste fundo apurado de acordo com a metodologia definida no Regulamento 2/2012 da CMVM.

| Ano | Rendibilidade | Volatilidade | Rend. Anualiz. % | |
|-------------|---------------|--------------|------------------|-------|
| 2010 | -11,59% | 11,32% | 1 ano | 0,95% |
| 2011 | -9,56% | 11,21% | 3 anos | 5,99% |
| 2012 | 34,97% | 15,70% | Desde o início | 0,33% |
| 2013 | 0,95% | 3,65% | | |

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

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

De acordo com o n.º 2 do art.º 12.º do Regulamento n.º 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 |