

CAIXA SEGURO NOSTRUM 12M MAIS ICAE

30 Junho 2014

O produto Caixa Seguro Nostrum – 12M Mais teve o início de comercialização em 2 de Maio de 2005. 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						7.661.483,94	100,0%
5. Líquidez						7.663.072,32	100,0%
5.1. À Vista						7.663.072,32	100,0%
Depósitos à Ordem						7.663.072,32	100,0%
9. Outros Activos						-1.588,38	0,0%
9.1. Devedores e Credores Diversos						-1.588,38	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						425,69	0,0%
Comissões						-2.014,07	0,0%

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

7.661.483,94
1.359.162,4845
5,63692

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. %	
2005	1,13%	0,01%	1 ano	0,46%
2006	1,36%	0,03%	3 anos	0,56%
2007	1,41%	0,03%	5 anos	0,89%
2008	1,62%	0,03%	Desde o início	1,34%
2009	1,52%	0,09%		
2010	0,85%	0,13%		
2011	0,46%	0,01%		
2012	0,46%	0,01%		
2013	0,46%	0,01%		

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