

CAIXA SEGURO VALORIZAÇÃO CRESCENTE ICAE

30 Junho 2014

O produto Caixa Seguro Valorização Crescente teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 24-08-2009 e 11-09-2009. 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					3.058.013,59	109.629.607,92	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					3.058.013,59	110.280.872,37	100,6%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					3.058.013,59	110.280.872,37	100,6%
1.2.3. Obrigações Diversas					3.058.013,59	110.280.872,37	100,6%
CGD Series 855, 3% STEP UP, 04/08/2014, CORP, EST)	67.698.209,70	117,93%	EUR	117,93%	459.901,21	80.296.399,91	73,2%
CGD Series 865, 12,2%, 15/09/2014, CORP, EST)	26.994.933,54	101,45%	EUR	101,45%	2.598.112,38	29.984.472,46	27,4%
9. Outros Activos						-651.264,45	-0,6%
9.1. Devedores e Credores Diversos						-651.264,45	-0,6%
Comissões						-651.264,45	-0,6%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

109.629.607,92

1.055.773,9882

103,83814

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	-10,64%	10,95%	1 ano	-0,21%
2011	-9,15%	11,38%	3 anos	4,90%
2012	31,95%	14,78%	Desde o início	0,74%
2013	-0,21%	3,74%		

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 Médio Baixo) de volatilidade, conforme quadro anexo.

De acordo com o nº2 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