

## CAIXA SEGURO PPR 2015 ICAE

31 Dezembro 2014

O produto Caixa Seguro PPR 2015 teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 10-12-2009 e 30-12-2009. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31-12-2014, sendo que as valorizações utilizadas correspondem às cotações disponíveis no último dia útil do exercício.

a)

| Designação                                | Quantidade | Cotação<br>Moeda<br>Origem | Moeda | Cotação<br>(EUR) | Juro<br>Decorrido<br>(EUR) | Montante Global<br>(EUR) | Peso   |
|---|------------|----------------------------|-------|------------------|----------------------------|--------------------------|--------|
| <b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>     |            |                            |       |                  | 0,00                       | 13.470.715,03            | 100,0% |
| <b>5. Liquidez</b>                        |            |                            |       |                  |                            | 13.595.843,24            | 100,9% |
| <b>5.1. À Vista</b>                       |            |                            |       |                  |                            | 13.595.843,24            | 100,9% |
| Depósitos à Ordem                         |            |                            |       |                  |                            | 13.595.843,24            | 100,9% |
| <b>9. Outros Activos</b>                  |            |                            |       |                  |                            | -125.128,21              | -0,9%  |
| <b>9.1. Devedores e Credores Diversos</b> |            |                            |       |                  |                            | -125.128,21              | -0,9%  |
| Juros de D.O. a Regularizar               |            |                            |       |                  |                            | -0,01                    | 0,0%   |
| Comissões                                 |            |                            |       |                  |                            | -125.128,20              | -0,9%  |

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

13.470.715,03  
117.808,4753  
114,34419

b)

O património do Fundo será representado, entre 95% e 100%, por obrigações de dívida pública, e privada, sénior, emitidas por emitentes 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, acessórios.

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 | -2,68%        | 8,44%        | 1 ano            | 0,62%  |
| 2011 | -12,85%       | 6,36%        | 3 anos           | 10,46% |
| 2012 | 31,97%        | 22,41%       | 5 anos           | 2,72%  |
| 2013 | 1,45%         | 0,55%        | Desde o início   | 2,72%  |
| 2014 | 0,62%         | 0,27%        |                  |        |

As rendibilidades divulgadas representam dados passados, não constituindo garantia de rentabilidade 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        |
| $\geq 20$                    | 6               | Risco muito alto  |