

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 Moeda Origem | Moeda | Cotação (EUR) | Juro Decorrido (EUR) | Montante Global (EUR) | Peso |
|---|------------|----------------------------|-------|------------------|----------------------------|--------------------------|--------|
| Parte I - Valores Patrimoniais | | | | | 0,00 | 13.470.715,03 | 100,0% |
| 5. Liquidez | | | | | | 13.595.843,24 | 100,9% |
| 5.1. À Vista | | | | | | 13.595.843,24 | 100,9% |
| Depósitos à Ordem | | | | | | 13.595.843,24 | 100,9% |
| 9. Outros Activos | | | | | | -125.128,21 | -0,9% |
| 9.1. Devedores e Credores Diversos | | | | | | -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 |
| ≥ 20 | 6 | Risco muito alto |