

## CAIXA SEGURO PPR 2018 ICAE

31 Dezembro 2015

O produto Caixa Seguro PPR 2018 ICAE teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 19-02-2010 e 26-02-2010. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31-12-2015, 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
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>2.619,88</b>	<b>129.730,70</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>2.619,88</b>	<b>118.533,43</b>	<b>91,4%</b>
<b>1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal</b>					<b>362,93</b>	<b>16.915,43</b>	<b>13,0%</b>
<b>1.1.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>362,93</b>	<b>16.915,43</b>	<b>13,0%</b>
PGB, 4.45%, 15/06/2018, GOVT	15.000,00	110,35%	EUR	110,35%	362,93	16.915,43	13,0%
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>2.256,95</b>	<b>101.618,00</b>	<b>78,3%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>685,73</b>	<b>24.755,72</b>	<b>19,1%</b>
BGB, 4%, 28/03/2017, GOVT	8.850,00	105,41%	EUR	105,41%	268,89	9.597,68	7,4%
NETHERLANDS, 4.5%, 15/07/2017, GOVT	5.000,00	107,44%	EUR	107,44%	103,89	5.475,64	4,2%
SPGB, 3.8%, 31/01/2017, GOVT	9.000,00	104,11%	EUR	104,11%	312,95	9.682,40	7,5%
<b>1.2.3. Obrigações Diversas</b>					<b>1.571,22</b>	<b>76.862,28</b>	<b>59,2%</b>
DEUTSCH BAHN FIN, 4.75%, 14/03/2018, CORP	10.000,00	110,19%	EUR	110,19%	378,96	11.398,36	8,8%
DEXIA MUN AGENCY, 4.5%, 13/11/2017, CORP	6.000,00	108,43%	EUR	108,43%	35,41	6.540,91	5,0%
ENI, 4.75%, 14/11/2017, CORP	15.000,00	108,09%	EUR	108,09%	91,50	16.305,00	12,6%
PROCTER & GAMBLE, 5.125%, 24/10/2017, CORP	12.000,00	109,14%	EUR	109,14%	114,26	13.210,70	10,2%
RABOBANK, 4.75%, 15/01/2018, CORP	13.000,00	109,21%	EUR	109,21%	592,12	14.789,81	11,4%
SHELL INT FIN, 4.375%, 14/05/2018, CORP	13.000,00	109,68%	EUR	109,68%	358,97	14.617,50	11,3%
<b>5. Liquidez</b>						<b>11.651,72</b>	<b>9,0%</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>11.651,72</b>	<b>9,0%</b>
Depósitos à Ordem						11.651,72	9,0%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-454,45</b>	<b>-0,4%</b>
<b>9.1. Devedores e Credores Diversos</b>						<b>-454,45</b>	<b>-0,4%</b>
Comissões						-454,45	-0,4%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

129.730,70

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

1.045.0000

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

124,14421

b)

O património do Fundo será representado, entre 95% e 100%, por obrigações de dívida pública e privada, sénior, emitidas por emittentes da União Europeia com notações de rating mínimas de A- (Standard & Poor's) na data de início do presente contrato.

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. %	
<b>2010</b>	1,56%	3,57%	1 ano	0,60%
<b>2011</b>	4,81%	4,16%	3 anos	2,33%
<b>2012</b>	9,10%	2,80%	5 anos	4,15%
<b>2013</b>	1,43%	2,04%	Desde o início	3,77%
<b>2014</b>	5,00%	0,99%		
<b>2015</b>	0,60%	0,58%		

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) 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