

CAIXA SEGURO 2017 ICAE

30 Junho 2017

O produto Caixa Seguro 2017 teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 12/10/2009 e 30/10/2009. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 30/06/2017, sendo que as valorizações utilizadas correspondem às cotações disponíveis no último dia útil do exercício.

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
Parte I - Valores Patrimoniais					1.395.730,26	49.400.044,00	100,0%
2. Valores Não Cotados					1.395.730,26	49.531.788,40	100,3%
2.1. Valores Mobiliários Nacionais					1.395.730,26	49.531.788,40	100,3%
2.1.3. Obrigações Diversas					1.395.730,26	49.531.788,40	100,3%
CGD Series 884, 3.71% STEP UP, 03/11/2017, CORP	47.872.757,97	100,55%	EUR	100,55%	1.395.730,26	49.531.788,40	100,3%
5. Liquidez						55.511,10	0,1%
5.1. À Vista						55.511,10	0,1%
Depósitos à Ordem						55.511,10	0,1%
9. Outros Activos						-187.255,50	-0,4%
9.1. Devedores e Credores Diversos						-187.255,50	-0,4%
Comissões						-187.255,50	-0,4%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

49.400.044,00

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

478.743,5839

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

103,18685

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

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. Anualizada	
2010	-19,24%	17,87%	1 Ano	2,81%
2011	-20,50%	17,99%	3 Anos	4,85%
2012	72,26%	30,22%	5 Anos	10,48%
2013	7,24%	8,35%	Desde o Início	0,47%
2014	10,23%	6,20%		
2015	1,70%	3,63%		
2016	2,81%	3,58%		

As rendibilidades divulgadas representam dados passados, não constituindo garantia de rentabilidade futura.

O produto tem uma volatilidade anual que se situa na classe 3 (Risco Médio/Baixo) de volatilidade, conforme quadro anexo.

Classe de Risco	Escalão de Risco	Volatilidade
1	Risco Muito Baixo	< 0,5%
2	Risco Baixo	0,5% - 2%
3	Risco Médio/Baixo	2% - 5%
4	Risco Médio	5% - 10%
5	Risco Médio/Alto	10% - 15%
6	Risco Alto	15% - 25%
7	Risco Muito Alto	>25%