

## CAIXA JUNHO 2018 ICAE

31 Dezembro 2017

O produto Caixa Junho 2018 teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 05/11/2012 e 23/11/2012. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31/12/2017, 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
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>678.722,72</b>	<b>34.226.228,69</b>	<b>100,0%</b>
1. Valores Mobiliários Cotados					668.145,53	28.772.694,69	84,1%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					668.145,53	28.772.694,69	84,1%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					668.145,53	28.772.694,69	84,1%
PGB, 4.45%, 15/06/2018, GOVT	27.539.170,00	102,05%	EUR	102,05%	668.145,53	28.772.694,69	84,1%
5. Liquidez						5.492.436,69	16,0%
5.1. À Vista						2.028.082,50	5,9%
Depósitos à Ordem						2.028.082,50	5,9%
5.2. A Prazo					10.577,19	3.464.354,19	10,1%
Depósitos e Outros Equiparados					10.577,19	3.464.354,19	10,1%
9. Outros Activos						-38.902,69	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores						-38.902,69	-0,1%
Comissões						-38.902,69	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

34.226.228,69

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

262.887,40

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

130,19349

O património do Fundo será representado inicialmente por 15% em Obrigações ou Depósitos da Caixa Geral de Depósitos, S.A. e o restante por Títulos de Dívida Pública Portuguesa, cujas notações de *rating* na data de subscrição do contrato, são, respetivamente, de BB- / Ba3 (*Standard & Poor's / Moody's*) e BB / Ba3 (*Standard & Poor's / Moody's*). O remanescente, se o houver, será representado por depósitos ou outros instrumentos de dívida de curto prazo, nomeadamente Bilhetes do Tesouro, Certificados de Depósito e depósitos denominados em euros. Contudo, poderão existir momentos em que os mercados financeiros se apresentem menos líquidos e em que simultaneamente exista maior volume de pedidos de resgate das unidades de participação. Nestas circunstâncias a Companhia, prevendo as necessidades de liquidez e para ser eficiente no preço de transação, poderá alienar um maior volume de ativos. Como consequência e para constituição de uma reserva de liquidez, os instrumentos de dívida de curto prazo podem atingir, temporariamente, percentagens superiores 5% do valor do Fundo. Este procedimento será um procedimento de exceção por não ser normal haver fortes afluências aos resgates e por o ativo da carteira ser líquido e facilmente transacionável. Durante a vigência do contrato, o património do fundo poderá passar a ser representado, entre 95% e 100%, por Títulos da Dívida Pública ou Privada de emitentes sedeados em Portugal, com maturidade máxima no ano de 2018 e com notação de *rating* mínima, na data de aquisição, de duas notas abaixo da notação da Dívida Pública Portuguesa.

Junto segue o histórico de rentabilidade e volatilidade deste fundo apurado de acordo com a metodologia definida no Regulamento 2/2012 da CMVM.

<b>Ano</b>	<b>Rendibilidade</b>	<b>Volatilidade</b>	<b>Rend. Anualizada</b>	
<b>2013</b>	7,99%	8,54%	<b>1 Ano</b>	-0,74%
<b>2014</b>	14,57%	4,11%	<b>3 Anos</b>	0,33%
<b>2015</b>	2,15%	2,03%	<b>5 Anos</b>	4,55%
<b>2016</b>	-0,41%	2,09%	<b>Desde o Início</b>	5,31%
<b>2017</b>	-0,74%	0,50%		

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 Baixo) de volatilidade, conforme quadro anexo.

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