

CAIXA OUTUBRO 2017 III ICAE

30 Junho 2017

O produto Caixa Outubro 2017 III teve um período de comercialização limitada, que decorreu entre 03/09/2012 e 21/09/2012. 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					862.659,75	37.419.393,95	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					862.659,75	29.376.073,96	78,5%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					862.659,75	29.376.073,96	78,5%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					862.659,75	29.376.073,96	78,5%
PGB, 4.35%, 16/10/2017, GOVT	28.165.013,00	101,24%	EUR	101,24%	862.659,75	29.376.073,96	78,5%
5. Liquidez						8.380.477,22	22,4%
5.1. À Vista						4.290.189,51	11,5%
Depósitos à Ordem						4.290.189,51	11,5%
5.2. A Prazo						4.090.287,71	10,9%
Depósitos e Outros Equiparados						4.090.287,71	10,9%
9. Outros Activos						-337.157,23	-0,9%
9.1. Devedores e Credores Diversos						-337.157,23	-0,9%
Comissões						-337.157,23	-0,9%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA	37.419.393,95
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO	292.560,01
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO	127,90331

O património do Fundo será representado inicialmente por 15% em Obrigações ou Depósitos da Caixa Geral de Depósitos, S.A. e o restante por Obrigações do Tesouro de Dívida Pública Portuguesa com maturidade em 16/10/2017, com o ISIN PTOTEL0E0010, 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 2017 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.

Ano	Rendibilidade	Volatilidade	Rend. Anualizada	
2013	5,24%	7,91%	1 Ano	-0,54%
2014	11,92%	3,65%	3 Anos	4,06%
2015	1,24%	1,18%	Desde o Início	6,07%
2016	-0,54%	1,33%		

O produto tem uma volatilidade anual que se situa na classe 2 (Risco 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%