

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

31 outubro 2024

O produto CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA – Invest Equilibrado teve o início de comercialização em 20/02/2006. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório na data de referência, sendo que as valorizações utilizadas correspondem às cotações disponíveis no último dia útil do período.

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
Parte I - Valores Patrimoniais					7.578,37	3.955.207,56	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					6.924,05	1.947.841,58	49,2%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					6.924,05	1.947.841,58	49,2%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					6.924,05	1.947.841,58	49,2%
AUSTRIA, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	91.000,00	72,72%	EUR	72,72%	6,86	66.185,70	1,7%
AUSTRIA, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	48.000,00	58,63%	EUR	58,63%	221,92	28.365,76	0,7%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	10.000,00	96,29%	EUR	96,29%	105,86	9.734,36	0,2%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	30.000,00	85,63%	EUR	85,63%	118,36	25.805,86	0,7%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	83.000,00	63,10%	EUR	63,10%	233,87	52.606,04	1,3%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	20.000,00	99,29%	EUR	99,29%	166,12	20.023,72	0,5%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	101.000,00	90,78%	EUR	90,78%	518,95	92.209,78	2,3%
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	88.000,00	77,63%	EUR	77,63%	0,00	68.315,28	1,7%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	41.000,00	75,39%	EUR	75,39%	0,00	30.907,85	0,8%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	100.000,00	52,05%	EUR	52,05%	0,00	52.046,00	1,3%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	190.000,00	92,32%	EUR	92,32%	336,13	175.736,53	4,4%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	109.000,00	95,62%	EUR	95,62%	114,97	104.344,04	2,6%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	180.000,00	85,01%	EUR	85,01%	0,00	153.019,80	3,9%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	49.000,00	85,94%	EUR	85,94%	0,00	42.111,58	1,1%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	96,03%	EUR	96,03%	0,00	19.205,00	0,5%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	137.000,00	98,90%	EUR	98,90%	0,00	135.490,26	3,4%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	250.000,00	95,56%	EUR	95,56%	582,31	239.487,31	6,1%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	76.000,00	50,56%	EUR	50,56%	248,30	38.672,38	1,0%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	180.000,00	85,05%	EUR	85,05%	980,14	154.068,34	3,9%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	77.000,00	93,22%	EUR	93,22%	646,48	72.423,97	1,8%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	48,43%	EUR	48,43%	0,00	16.950,15	0,4%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	57.000,00	112,57%	EUR	112,57%	1.693,65	65.856,27	1,7%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	29.000,00	97,77%	EUR	97,77%	0,00	28.352,43	0,7%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	85,52%	EUR	85,52%	0,00	51.312,60	1,3%
SPGB, 0.85%, 30/07/2037, GOVT	25.000,00	74,72%	EUR	74,72%	54,14	18.733,89	0,5%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	65.000,00	67,51%	EUR	67,51%	165,62	44.045,82	1,1%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	147.000,00	95,99%	EUR	95,99%	730,37	141.831,26	3,6%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					654,32	63.107,47	1,6%
1.3.3. Obrigações Diversas					654,32	63.107,47	1,6%
BGB, 2.25%, 22/06/2057, GOVT	15.000,00	75,92%	EUR	75,92%	121,13	11.508,38	0,3%
BGB, 2.75%, 22/04/2039, GOVT	25.000,00	94,86%	EUR	94,86%	361,64	24.075,64	0,6%
BTPS, 3.45%, 01/03/2048, GOVT	30.000,00	91,17%	EUR	91,17%	171,55	27.523,45	0,7%
2. Valores Não Cotados					0,00	539.257,52	13,6%
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					0,00	539.257,52	13,6%
2.2.3. Obrigações Diversas					0,00	539.257,52	13,6%
VONTOBEL-EUR CRP BOND-GE (FIM)	4.837,26	111,48%	EUR	111,48%	0,00	539.257,52	13,6%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.170.674,80	29,6%
3.1. Fundos Harmonizados						1.170.674,80	29,6%
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	1,39	11.507,74	EUR	11.507,74		16.030,28	0,4%
AMUNDI-CASH USD-R2 C, USD	551,94	118,04	USD	108,47		59.870,64	1,5%
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1.009,16	105,89	EUR	105,89		106.859,74	2,7%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	2.480,49	217,62	EUR	217,62		539.803,36	13,6%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	22.387,53	4,78	EUR	4,78		106.902,67	2,7%
GROUPAMA MONETAIRE	0,07	227.188,45	EUR	227.188,45		16.130,38	0,4%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	1.959,00	111,42	EUR	111,42		218.271,78	5,5%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	609,62	175,20	EUR	175,20		106.805,95	2,7%
4. Imobiliário					0,00	157.092,29	4,0%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						157.092,29	4,0%
FUNDIMO (FII)	18.057,00	8,70	EUR	8,70		157.092,29	4,0%
5. Liquidez					0,00	79.966,28	2,0%
5.1. À Vista						79.966,28	2,0%
Depósitos à Ordem						79.966,28	2,0%
9. Outros Activos						-2.732,39	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores						-2.732,39	-0,1%
Juros de D.O. a Regularizar						479,61	0,0%
Comissões						-3.212,00	-0,1%
VALOR TOTAL DA CARTEIRA						3.955.207,56	
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO						631.989,43	
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO						6,26	

O Fundo Autónomo de Investimento da opção de investimento Invest Equilibrado-ICAE será composto pela seguinte carteira de activos:

Composição do Fundo	Invest Equilibrado
Ações e outras Participações de Rendimento Variável	Máximo 10%
Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Fixa	20% - 80%
Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Variável e Depósitos em Instituições de Crédito	10% - 80%
Instrumentos de Retorno Absoluto e outras Classes de Activos	Máximo 5%
Imobiliário	Máximo 20%
Tipo de Risco da Opção	Baixo/Médio

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
2008	1,95%	3,05%
2009	4,91%	2,55%
2010	-1,11%	3,05%
2011	-0,64%	2,74%
2012	12,23%	2,39%
2013	2,43%	1,52%
2014	5,77%	1,13%
2015	0,13%	2,43%
2016	2,45%	1,93%
2017	0,94%	1,43%
2018	-1,31%	1,00%
2019	3,16%	1,41%
2020	1,95%	2,90%
2021	-2,05%	1,58%
2022	-14,71%	6,24%
2023	5,70%	5,45%

	Rend. Anualizada
1 Ano	5,70%
3 Anos	-4,07%
5 Anos	-1,47%
Desde o Inicio	13,35%

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