

# 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          |
|--|------------|----------------------|-------|---------------|----------------------|-----------------------|---------------|
| <b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>  |            |                      |       |               | <b>7.578,37</b>      | <b>3.955.207,56</b>   | <b>100,0%</b> |
| <b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>  |            |                      |       |               | <b>6.924,05</b>      | <b>1.947.841,58</b>   | <b>49,2%</b>  |
| <b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>                                   |            |                      |       |               | <b>6.924,05</b>      | <b>1.947.841,58</b>   | <b>49,2%</b>  |
| <b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>                                      |            |                      |       |               | <b>6.924,05</b>      | <b>1.947.841,58</b>   | <b>49,2%</b>  |
| 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%          |
| <b>1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.</b>                     |            |                      |       |               | <b>654,32</b>        | <b>63.107,47</b>      | <b>1,6%</b>   |
| <b>1.3.3. Obrigações Diversas</b>  |            |                      |       |               | <b>654,32</b>        | <b>63.107,47</b>      | <b>1,6%</b>   |
| 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%          |
| <b>2. Valores Não Cotados</b>  |            |                      |       |               | <b>0,00</b>          | <b>539.257,52</b>     | <b>13,6%</b>  |
| <b>2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros</b>                                 |            |                      |       |               | <b>0,00</b>          | <b>539.257,52</b>     | <b>13,6%</b>  |
| <b>2.2.3. Obrigações Diversas</b>  |            |                      |       |               | <b>0,00</b>          | <b>539.257,52</b>     | <b>13,6%</b>  |
| VONTOBEL-EUR CRP BOND-GE (FIM)   | 4.837,26   | 111,48%              | EUR   | 111,48%       | 0,00                 | 539.257,52            | 13,6%         |
| <b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b> |            |                      |       |               |                      | <b>1.170.674,80</b>   | <b>29,6%</b>  |
| <b>3.1. Fundos Harmonizados</b>  |            |                      |       |               |                      | <b>1.170.674,80</b>   | <b>29,6%</b>  |
| 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%          |
| <b>4. Imobiliário</b>  |            |                      |       |               | <b>0,00</b>          | <b>157.092,29</b>     | <b>4,0%</b>   |
| <b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>   |            |                      |       |               |                      | <b>157.092,29</b>     | <b>4,0%</b>   |
| FUNDIMO (FII)  | 18.057,00  | 8,70                 | EUR   | 8,70          |                      | 157.092,29            | 4,0%          |
| <b>5. Liquidez</b>   |            |                      |       |               | <b>0,00</b>          | <b>79.966,28</b>      | <b>2,0%</b>   |
| <b>5.1. À Vista</b>  |            |                      |       |               |                      | <b>79.966,28</b>      | <b>2,0%</b>   |
| Depósitos à Ordem  |            |                      |       |               |                      | 79.966,28             | 2,0%          |
| <b>9. Outros Activos</b>   |            |                      |       |               |                      | <b>-2.732,39</b>      | <b>-0,1%</b>  |
| <b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>                                      |            |                      |       |               |                      | <b>-2.732,39</b>      | <b>-0,1%</b>  |
| Juros de D.O. a Regularizar  |            |                      |       |               |                      | 479,61                | 0,0%          |
| Comissões  |            |                      |       |               |                      | -3.212,00             | -0,1%         |
| <b>VALOR TOTAL DA CARTEIRA</b>   |            |                      |       |               |                      | <b>3.955.207,56</b>   |               |
| <b>NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO</b>                                    |            |                      |       |               |                      | <b>631.989,43</b>     |               |
| <b>VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO</b>                                   |            |                      |       |               |                      | <b>6,26</b>           |               |

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

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

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.