

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

30 novembro 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					8.582,52	4.010.231,42	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					8.582,52	2.063.106,01	51,4%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					8.582,52	2.063.106,01	51,4%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					8.582,52	2.063.106,01	51,4%
AUSTRIA, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	91.000,00	75,70%	EUR	75,70%	25,55	68.908,00	1,7%
AUSTRIA, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	48.000,00	62,81%	EUR	62,81%	251,51	30.398,39	0,8%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	10.000,00	99,12%	EUR	99,12%	125,59	10.037,29	0,3%
BGB, 2.25%, 22/06/2057, GOVT	15.000,00	80,02%	EUR	80,02%	148,87	12.152,32	0,3%
BGB, 2.75%, 22/04/2039, GOVT	25.000,00	98,10%	EUR	98,10%	418,15	24.943,40	0,6%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	30.000,00	87,97%	EUR	87,97%	141,72	26.533,32	0,7%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	83.000,00	66,83%	EUR	66,83%	350,80	55.820,53	1,4%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	20.000,00	99,71%	EUR	99,71%	198,91	20.141,31	0,5%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	101.000,00	94,55%	EUR	94,55%	778,43	96.270,90	2,4%
BTPS, 3.45%, 01/03/2048, GOVT	30.000,00	95,54%	EUR	95,54%	257,32	28.918,72	0,7%
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	88.000,00	80,15%	EUR	80,15%	0,00	70.529,36	1,8%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	41.000,00	77,99%	EUR	77,99%	0,00	31.976,31	0,8%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	100.000,00	56,08%	EUR	56,08%	0,00	56.080,00	1,4%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	190.000,00	93,71%	EUR	93,71%	375,07	178.424,07	4,4%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	109.000,00	96,58%	EUR	96,58%	159,77	105.431,97	2,6%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	180.000,00	87,08%	EUR	87,08%	0,00	156.745,80	3,9%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	49.000,00	87,31%	EUR	87,31%	0,00	42.779,94	1,1%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	96,66%	EUR	96,66%	0,00	19.331,00	0,5%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	137.000,00	99,19%	EUR	99,19%	0,00	135.893,04	3,4%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	250.000,00	96,34%	EUR	96,34%	8,56	240.861,06	6,0%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	76.000,00	53,15%	EUR	53,15%	295,15	40.692,19	1,0%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	180.000,00	86,89%	EUR	86,89%	1.165,07	157.572,47	3,9%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	77.000,00	95,26%	EUR	95,26%	731,92	74.079,81	1,8%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	52,98%	EUR	52,98%	0,00	18.541,25	0,5%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	57.000,00	117,62%	EUR	117,62%	1.868,85	68.914,53	1,7%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	29.000,00	98,15%	EUR	98,15%	0,00	28.464,66	0,7%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	87,42%	EUR	87,42%	24,66	52.476,66	1,3%
SPGB, 0.85%, 30/07/2037, GOVT	25.000,00	77,56%	EUR	77,56%	71,61	19.460,61	0,5%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	65.000,00	70,82%	EUR	70,82%	219,04	46.249,44	1,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	147.000,00	97,63%	EUR	97,63%	965,97	144.477,66	3,6%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.671.146,49	41,7%
3.1. Fundos Harmonizados						1.671.146,49	41,7%
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	1,39	11.539,16	EUR	11.539,16		16.074,05	0,4%
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1.009,16	106,71	EUR	106,71		107.687,25	2,7%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	2.480,49	220,55	EUR	220,55		547.071,19	13,6%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	22.387,53	4,80	EUR	4,80		107.482,51	2,7%
GROUPAMA MONETAIRE	0,07	227.861,27	EUR	227.861,27		16.178,15	0,4%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	1.959,00	114,21	EUR	114,21		223.727,60	5,6%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	609,62	176,30	EUR	176,30		107.476,53	2,7%
VONTOBEL-EUR CRP BOND-GE (FIM)	4.837,26	112,76	EUR	112,76		545.449,21	13,6%
4. Imobiliário					0,00	158.125,15	3,9%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						158.125,15	3,9%
FUNDIMO (FII)	18.057,00	8,76	EUR	8,76		158.125,15	3,9%
5. Liquidez					0,00	81.274,38	2,0%
5.1. À Vista						81.274,38	2,0%
Depósitos à Ordem						81.274,38	2,0%
9. Outros Activos						36.579,38	0,9%
9.1. Outros Devedores E Credores						36.579,38	0,9%
Juros de D.O. a Regularizar						-72,91	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	39.745,59	1,0%
Comissões						-3.093,30	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

4.010.231,42
628.986,24
6,38

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

Composição do Fundo	Invest Equilibrado
Acções 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.