

# CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

## INVEST EQUILIBRADO

31 dezembro 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>9.950,78</b>	<b>3.928.425,37</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>9.950,78</b>	<b>1.971.294,58</b>	<b>50,2%</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>9.950,78</b>	<b>1.971.294,58</b>	<b>50,2%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>9.950,78</b>	<b>1.971.294,58</b>	<b>50,2%</b>
AUSTRIA, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	56.000,00	73,73%	EUR	73,73%	27,62	41.314,74	1,1%
AUSTRIA, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	11.000,00	59,70%	EUR	59,70%	64,64	6.631,97	0,2%
AUSTRIA, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	68.000,00	97,52%	EUR	97,52%	100,60	66.416,24	1,7%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	26.000,00	97,04%	EUR	97,04%	379,53	25.609,41	0,7%
AUSTRIA, 3.15%, 20/06/2044, GOVT	16.000,00	101,38%	EUR	101,38%	267,88	16.488,04	0,4%
BGB, 0.8%, 22/06/2027, GOVT	92.000,00	96,58%	EUR	96,58%	387,16	89.237,08	2,3%
BGB, 2.25%, 22/06/2057, GOVT	13.000,00	75,06%	EUR	75,06%	153,86	9.911,27	0,3%
BGB, 2.75%, 22/04/2039, GOVT	54.000,00	94,73%	EUR	94,73%	1.029,33	52.183,53	1,3%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	97.000,00	86,71%	EUR	86,71%	75,95	84.187,56	2,1%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	85.000,00	64,00%	EUR	64,00%	483,00	54.882,15	1,4%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	41.000,00	91,90%	EUR	91,90%	424,84	38.103,02	1,0%
BTPS, 3.45%, 01/03/2048, GOVT	76.000,00	92,21%	EUR	92,21%	876,41	70.955,25	1,8%
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	40.000,00	78,14%	EUR	78,14%	0,00	31.255,20	0,8%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	167.000,00	75,82%	EUR	75,82%	0,00	126.626,08	3,2%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	165.000,00	96,34%	EUR	96,34%	311,92	159.286,32	4,1%
DBR, CZ, 15/02/2030, GOVT	20.000,00	89,98%	EUR	89,98%	0,00	17.996,20	0,5%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	30.000,00	85,75%	EUR	85,75%	0,00	25.725,30	0,7%
DBR, CZ, 15/08/2031, GOVT	87.000,00	86,93%	EUR	86,93%	0,00	75.625,62	1,9%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	11.000,00	86,48%	EUR	86,48%	0,00	9.512,25	0,2%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	36.000,00	96,74%	EUR	96,74%	0,00	34.825,32	0,9%
EUROPEAN UNION, CZ, 04/07/2035, GOVT	14.000,00	73,60%	EUR	73,60%	0,00	10.304,56	0,3%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	1.000,00	99,40%	EUR	99,40%	0,00	993,95	0,0%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	199.000,00	96,31%	EUR	96,31%	49,07	191.701,99	4,9%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	89.000,00	49,58%	EUR	49,58%	402,33	44.524,97	1,1%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	175.000,00	84,80%	EUR	84,80%	1.318,49	149.725,49	3,8%
IRISH, 1% 15/05/2026, GOVT	21.000,00	98,49%	EUR	98,49%	132,33	20.815,65	0,5%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	37.000,00	94,13%	EUR	94,13%	394,13	35.221,49	0,9%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	21.000,00	49,55%	EUR	49,55%	0,00	10.406,34	0,3%
NETHER, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	108.000,00	95,09%	EUR	95,09%	375,04	103.073,32	2,6%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	24.000,00	113,39%	EUR	113,39%	863,11	28.076,71	0,7%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	116.000,00	86,26%	EUR	86,26%	96,93	100.158,53	2,5%
SPGB, 0.85%, 30/07/2037, GOVT	72.000,00	75,23%	EUR	75,23%	258,21	54.423,09	1,4%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	54.000,00	67,97%	EUR	67,97%	227,84	36.930,02	0,9%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	152.000,00	96,67%	EUR	96,67%	1.250,56	148.185,92	3,8%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>1.641.253,09</b>	<b>41,8%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>1.641.253,09</b>	<b>41,8%</b>
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	1,39	11.569,65	EUR	11.569,65		16.116,52	0,4%
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1.009,16	106,87	EUR	106,87		107.848,72	2,7%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	2.418,74	220,23	EUR	220,23		532.678,01	13,6%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	22.387,53	4,81	EUR	4,81		107.675,04	2,7%
GROUPEM MONETAIRE	0,07	228.469,15	EUR	228.469,15		16.221,31	0,4%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	1.959,00	112,39	EUR	112,39		220.162,22	5,6%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	609,62	176,63	EUR	176,63		107.677,71	2,7%
VONTOBEL-EUR CRP BOND-GE (FIM)	4.732,03	112,61	EUR	112,61		532.873,56	13,6%
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>156.303,20</b>	<b>4,0%</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>						<b>156.303,20</b>	<b>4,0%</b>
FUNDIMO (FII)	18.057,00	8,66	EUR	8,66		156.303,20	4,0%
<b>5. Liquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>162.799,52</b>	<b>4,1%</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>162.799,52</b>	<b>4,1%</b>
Depósitos à Ordem						162.799,52	4,1%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-3.225,03</b>	<b>-0,1%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-3.225,03</b>	<b>-0,1%</b>
Juros de D.O. a Regularizar						-24,77	0,0%
Comissões						-3.200,26	-0,1%

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

3.928.425,37  
622.480,82  
6,31

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%
2024	1,69%	3,43%

	Rend. Anualizada
1 Ano	1,69%
3 Anos	-2,86%
5 Anos	-1,75%
Desde o Inicio	8,92%

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