

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

31 maio 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					7.791,25	3.904.220,30	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					7.791,25	2.113.348,61	54,1%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					7.791,25	2.113.348,61	54,1%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					7.791,25	2.113.348,61	54,1%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	10.000,00	93,74%	EUR	93,74%	5,26	9.379,06	0,2%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	30.000,00	82,40%	EUR	82,40%	141,72	24.860,52	0,6%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	48.000,00	59,55%	EUR	59,55%	201,78	28.785,30	0,7%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	70.000,00	87,34%	EUR	87,34%	536,60	61.673,20	1,6%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	126.000,00	72,48%	EUR	72,48%	0,00	91.327,32	2,3%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	163.000,00	48,99%	EUR	48,99%	0,00	79.850,44	2,0%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	250.000,00	89,54%	EUR	89,54%	181,01	224.028,51	5,7%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	219.000,00	93,11%	EUR	93,11%	868,52	204.785,99	5,2%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	235.000,00	82,10%	EUR	82,10%	0,00	192.925,60	4,9%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	49.000,00	83,02%	EUR	83,02%	0,00	40.679,31	1,0%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	93,74%	EUR	93,74%	0,00	18.748,80	0,5%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	137.000,00	97,23%	EUR	97,23%	0,00	133.203,73	3,4%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	250.000,00	93,30%	EUR	93,30%	321,04	233.558,54	6,0%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	101.000,00	50,43%	EUR	50,43%	12,45	50.943,72	1,3%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	70.000,00	84,06%	EUR	84,06%	14,38	58.857,78	1,5%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	77.000,00	90,66%	EUR	90,66%	210,75	70.017,41	1,8%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	45,65%	EUR	45,65%	0,00	15.978,20	0,4%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	127.000,00	109,73%	EUR	109,73%	1.782,68	141.133,43	3,6%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	114.000,00	95,83%	EUR	95,83%	0,00	109.241,64	2,8%
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	91.000,00	70,01%	EUR	70,01%	139,23	63.849,24	1,6%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	48.000,00	55,71%	EUR	55,71%	71,01	26.812,77	0,7%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	82,60%	EUR	82,60%	174,59	49.733,39	1,3%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	192.000,00	93,67%	EUR	93,67%	3.130,23	182.974,71	4,7%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.547.764,69	39,6%
3.1. Fundos Harmonizados						1.547.764,69	39,6%
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	950,51	102,77	EUR	102,77		97.683,91	2,5%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	2.478,91	209,47	EUR	209,47		519.256,86	13,3%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	22.387,53	4,67	EUR	4,67		104.482,58	2,7%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	551,00	109,12	EUR	109,12		60.125,12	1,5%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	609,62	171,07	EUR	171,07		104.288,21	2,7%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	3.152,49	164,51	EUR	164,51		518.616,46	13,3%
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1.567,00	91,46	EUR	91,46		143.311,55	3,7%
4. Imobiliário					0,00	155.503,27	4,0%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						155.503,27	4,0%
FUNDIMO (FII)	18.057,00	8,61	EUR	8,61		155.503,27	4,0%
5. Liquidez					0,00	89.667,94	2,3%
5.1. À Vista						89.667,94	2,3%
Depósitos à Ordem						89.667,94	2,3%
9. Outros Activos						-2.064,22	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores						-2.064,22	-0,1%
Juros de D.O. a Regularizar						74,94	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	1.031,56	0,0%
Comissões						-3.170,72	-0,1%
VALOR TOTAL DA CARTEIRA						3.904.220,30	
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO						641.607,67	
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO						6,09	

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.