

# CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

## INVEST EQUILIBRADO

31 julho 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>5.092,30</b>	<b>3.979.920,91</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>5.092,30</b>	<b>2.006.558,79</b>	<b>50,4%</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>5.092,30</b>	<b>2.006.558,79</b>	<b>50,4%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>5.092,30</b>	<b>2.006.558,79</b>	<b>50,4%</b>
AUSTRIA, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	91.000,00	72,76%	EUR	72,76%	177,15	66.389,66	1,7%
AUSTRIA, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	48.000,00	58,85%	EUR	58,85%	131,18	28.377,74	0,7%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	10.000,00	96,59%	EUR	96,59%	45,37	9.704,67	0,2%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	48.000,00	62,21%	EUR	62,21%	337,04	30.197,84	0,8%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	61.000,00	90,05%	EUR	90,05%	781,07	55.709,13	1,4%
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	125.000,00	77,97%	EUR	77,97%	0,00	97.466,25	2,4%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	126.000,00	75,74%	EUR	75,74%	0,00	95.436,18	2,4%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	133.000,00	52,87%	EUR	52,87%	0,00	70.311,78	1,8%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	250.000,00	91,79%	EUR	91,79%	285,18	229.757,68	5,8%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	129.000,00	94,82%	EUR	94,82%	619,21	122.942,17	3,1%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	235.000,00	85,02%	EUR	85,02%	0,00	199.801,70	5,0%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	49.000,00	85,08%	EUR	85,08%	0,00	41.686,75	1,0%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	94,97%	EUR	94,97%	0,00	18.994,00	0,5%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	137.000,00	97,92%	EUR	97,92%	0,00	134.147,66	3,4%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	250.000,00	94,54%	EUR	94,54%	425,20	236.765,20	5,9%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	76.000,00	51,56%	EUR	51,56%	104,63	39.289,47	1,0%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	180.000,00	85,60%	EUR	85,60%	413,01	154.485,81	3,9%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	77.000,00	92,94%	EUR	92,94%	384,47	71.950,58	1,8%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	49,10%	EUR	49,10%	0,00	17.185,70	0,4%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	57.000,00	113,86%	EUR	113,86%	1.156,35	66.055,41	1,7%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	29.000,00	96,76%	EUR	96,76%	0,00	28.061,27	0,7%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	84,91%	EUR	84,91%	224,59	51.169,99	1,3%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	147.000,00	95,69%	EUR	95,69%	7,85	140.672,15	3,5%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>1.726.729,90</b>	<b>43,4%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>1.726.729,90</b>	<b>43,4%</b>
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	2,78	11.404,23	EUR	11.404,23		31.680,95	0,8%
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1.009,16	104,32	EUR	104,32		105.275,36	2,6%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	2.535,61	214,25	EUR	214,25		543.254,66	13,6%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES, FIM	22.387,53	4,72	EUR	4,72		105.635,54	2,7%
GROUPAMA MONETAIRE	0,14	225.103,43	EUR	225.103,43		31.514,48	0,8%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	551,00	110,83	EUR	110,83		61.067,33	1,5%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	609,62	173,36	EUR	173,36		105.684,24	2,7%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	3.227,29	168,30	EUR	168,30		543.153,58	13,6%
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	2.122,00	94,00	EUR	94,00		199.463,76	5,0%
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>154.715,99</b>	<b>3,9%</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>						<b>154.715,99</b>	<b>3,9%</b>
FUNDIMO (FIL)	18.057,00	8,57	EUR	8,57		154.715,99	3,9%
<b>5. Líquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>94.986,51</b>	<b>2,4%</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>94.986,51</b>	<b>2,4%</b>
Depósitos à Ordem						94.986,51	2,4%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-3.070,29</b>	<b>-0,1%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-3.070,29</b>	<b>-0,1%</b>
Juros de D.O. a Regularizar						118,38	0,0%
Comissões						-3.188,67	-0,1%
<b>VALOR TOTAL DA CARTEIRA</b>						<b>3.979.920,91</b>	
<b>NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>639.992,78</b>	
<b>VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>6,22</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
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.