

**CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE**

**INVEST EQUILIBRADO**

**31 março 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>6.678,55</b>	<b>4.040.691,11</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>6.678,55</b>	<b>2.197.568,92</b>	<b>54,4%</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>6.678,55</b>	<b>2.197.568,92</b>	<b>54,4%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>6.678,55</b>	<b>2.197.568,92</b>	<b>54,4%</b>
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	10.000,00	96,42%	EUR	96,42%	205,25	9.846,95	0,2%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	30.000,00	83,64%	EUR	83,64%	94,22	25.186,82	0,6%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	48.000,00	62,32%	EUR	62,32%	66,52	29.978,68	0,7%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	70.000,00	89,74%	EUR	89,74%	176,90	62.995,60	1,6%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	126.000,00	75,23%	EUR	75,23%	0,00	94.787,28	2,3%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	163.000,00	53,36%	EUR	53,36%	0,00	86.968,65	2,2%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	250.000,00	90,76%	EUR	90,76%	76,84	226.979,34	5,6%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	219.000,00	93,81%	EUR	93,81%	685,83	206.136,30	5,1%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	235.000,00	84,10%	EUR	84,10%	0,00	197.623,25	4,9%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	49.000,00	84,33%	EUR	84,33%	0,00	41.320,23	1,0%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	93,82%	EUR	93,82%	0,00	18.763,40	0,5%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	137.000,00	96,77%	EUR	96,77%	0,00	132.568,05	3,3%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	250.000,00	93,64%	EUR	93,64%	216,87	234.316,87	5,8%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	101.000,00	53,79%	EUR	53,79%	643,67	54.969,55	1,4%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	70.000,00	86,27%	EUR	86,27%	743,51	61.133,21	1,5%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	77.000,00	92,48%	EUR	92,48%	37,02	71.243,54	1,8%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	49,51%	EUR	49,51%	0,00	17.329,20	0,4%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	127.000,00	114,90%	EUR	114,90%	988,93	146.906,85	3,6%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	156.000,00	95,67%	EUR	95,67%	0,00	149.243,64	3,7%
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	91.000,00	72,31%	EUR	72,31%	101,32	65.905,24	1,6%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	48.000,00	59,33%	EUR	59,33%	10,85	28.486,85	0,7%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	83,66%	EUR	83,66%	124,59	50.318,79	1,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	192.000,00	94,82%	EUR	94,82%	2.506,23	184.560,63	4,6%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>1.646.069,77</b>	<b>40,7%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>1.646.069,77</b>	<b>40,7%</b>
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1.044,13	102,47	EUR	102,47		106.992,00	2,6%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	2.625,26	210,15	EUR	210,15		551.699,02	13,7%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	24.612,65	4,64	EUR	4,64		114.310,98	2,8%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	551,00	110,82	EUR	110,82		61.059,07	1,5%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	669,88	170,35	EUR	170,35		114.114,23	2,8%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	3.336,87	165,31	EUR	165,31		551.618,15	13,7%
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1.567,00	93,35	EUR	93,35		146.276,32	3,6%
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>154.640,15</b>	<b>3,8%</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>						<b>154.640,15</b>	<b>3,8%</b>
FUNDIMO (FII)	18.057,00	8,56	EUR	8,56		154.640,15	3,8%
<b>5. Liquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>43.586,83</b>	<b>1,1%</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>43.586,83</b>	<b>1,1%</b>
Depósitos à Ordem						43.586,83	1,1%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-1.174,57</b>	<b>0,0%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-1.174,57</b>	<b>0,0%</b>
Juros de D.O. a Regularizar						-1,64	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	2.215,00	0,1%
Comissões						-3.387,93	-0,1%
<b>VALOR TOTAL DA CARTEIRA</b>						<b>4.040.691,11</b>	
<b>NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>655.224,90</b>	
<b>VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>6,17</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>	Máximo 10%
<b>Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Fixa</b>	20% - 80%
<b>Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Variável e Depósitos em Instituições de Crédito</b>	10% - 80%
<b>Instrumentos de Retorno Absoluto e outras Classes de Activos</b>	Máximo 5%
<b>Imobiliário</b>	Máximo 20%
<b>Tipo de Risco da Opção</b>	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.