

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST DINÂMICO

30 abril 2020

O produto CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA – Invest + Dinâmico teve o início de comercialização em 20/02/2006. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 30/04/2020, 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					1.600,71	1.796.314,63	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					1.600,71	403.737,32	22,5%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					1.600,71	403.737,32	22,5%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					1.600,71	403.737,32	22,5%
BOTS, CZ, 14/10/2020, GOVT	38.000,00	100,01%	EUR	100,01%	0,00	38.001,90	2,1%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	17.000,00	124,29%	EUR	124,29%	165,36	21.294,66	1,2%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	50.000,00	109,02%	EUR	109,02%	177,10	54.688,10	3,0%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	72.000,00	102,08%	EUR	102,08%	575,41	74.072,29	4,1%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	37.000,00	103,77%	EUR	103,77%	39,68	38.433,10	2,1%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	9.000,00	117,01%	EUR	117,01%	196,48	10.727,29	0,6%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	5.000,00	101,06%	EUR	101,06%	0,00	5.053,10	0,3%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	18.000,00	109,86%	EUR	109,86%	106,97	19.881,23	1,1%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	18.000,00	107,27%	EUR	107,27%	71,19	19.380,33	1,1%
SPGB, 0,45%, 31/10/2022, GOVT	120.000,00	101,61%	EUR	101,61%	268,52	122.205,32	6,8%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.297.783,15	72,2%
3.1. Fundos Harmonizados						1.297.783,15	72,2%
CAIXA OBRIGAÇÕES LONGO PRAZO, FIM	4.863,00	12,76	EUR	12,76		62.050,91	3,5%
CAIXAGEST AÇÕES EUROPA, FIM	20.547,86	8,71	EUR	8,71		179.000,61	10,0%
CAIXAGEST AÇÕES PORTUGAL, FIM	8.060,00	9,43	EUR	9,43		76.022,73	4,2%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES MAIS, FIM	10.369,37	5,65	EUR	5,65		58.544,45	3,3%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	104.555,30	4,34	EUR	4,34		454.031,40	25,3%
HYPO DOW DJ EURO STOXX 50 ETF, FIM	2.693,00	29,50	EUR	29,50		79.430,04	4,4%
ISHARES BARCLAYS CAPITAL EURO INFLATION BOND (FIM)	260,00	208,81	EUR	208,81		54.290,60	3,0%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	2.460,00	135,94	EUR	135,94		334.412,40	18,6%
5. Liquidez					0,00	95.599,54	5,3%
5.1. À Vista					0,00	95.599,54	5,3%
Depósitos à Ordem						95.599,54	5,3%
9. Outros Activos						-805,38	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores						-805,38	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						-5,71	0,0%
Comissões						-799,67	0,0%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

1.796.314,63

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

299.147,06

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6,0048

O Fundo Autónomo de Investimento da opção de investimento Invest + Dinâmico – ICAE é composto pela seguinte carteira de activos:

Composição do Fundo	Invest + Dinâmico
Acções e outras Participações de Rendimento Variável	5% - 30%
Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Fixa	10% - 65%
Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Variável e Depósitos em Instituições de Crédito	40% - 85%
Instrumentos de Retorno Absoluto e outras Classes de Activos	Máximo 20%
Imobiliário	Máximo 20%
Tipo de Risco da Opção	Médio/Elevado

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	Rend. Anualizada	
2008	-7,99%	3,69%	1 Ano	6,55%
2009	8,65%	3,73%	3 Anos	1,18%
2010	-1,57%	4,82%	5 Anos	1,23%
2011	-4,25%	5,67%	Desde o Inicio	1,68%
2012	12,76%	4,02%		
2013	3,66%	2,66%		
2014	2,94%	2,94%		
2015	1,00%	3,84%		
2016	1,59%	4,49%		
2017	2,44%	1,86%		
2018	-5,10%	3,59%		
2019	6,55%	2,32%		

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

Não se apresentam valores referentes ao ano de 2020, na medida em que o período em análise é inferior a doze meses.