

**CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE**

**INVEST EQUILIBRADO**

**28 fevereiro 2021**

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 com referência a 28/02/2021, 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>13.776,80</b>	<b>7.515.868,00</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>13.776,80</b>	<b>3.429.227,73</b>	<b>45,6%</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>13.776,80</b>	<b>3.429.227,73</b>	<b>45,6%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>13.776,80</b>	<b>3.429.227,73</b>	<b>45,6%</b>
BKO, 0%, 10/09/2021, GOVT	168.000,00	100,32%	EUR	100,32%	0,00	168.532,56	2,2%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	470.000,00	108,86%	EUR	108,86%	2.298,35	513.949,75	6,8%
BTPS, 3,45%, 01/03/2048, GOVT	80.000,00	140,12%	EUR	140,12%	1.361,10	113.460,30	1,5%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	188.000,00	140,12%	EUR	140,12%	556,27	263.974,35	3,5%
DBR, 0,25%, 15/02/2029, GOVT	10.000,00	105,19%	EUR	105,19%	0,89	10.519,49	0,1%
DBR, 0,5%, 15/08/2027, GOVT	20.000,00	106,50%	EUR	106,50%	53,92	21.353,52	0,3%
DBR, 1,5%, 15/02/2023, GOVT	265.000,00	104,29%	EUR	104,29%	141,58	276.507,43	3,7%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	52.000,00	100,82%	EUR	100,82%	0,00	52.428,48	0,7%
FRTR, 0,25%, 25/11/2026, GOVT	485.000,00	103,47%	EUR	103,47%	315,58	502.149,93	6,7%
FRTR, 2%, 25/05/2048, GOVT	60.000,00	133,14%	EUR	133,14%	917,26	80.800,66	1,1%
FRTR, 3%, 25/04/2022, GOVT	95.000,00	104,18%	EUR	104,18%	2.412,74	101.379,94	1,3%
RAGB, 0%, 15/07/2023, GOVT	140.000,00	101,36%	EUR	101,36%	0,00	141.898,40	1,9%
RAGB, 0,75%, 20/10/2026, GOVT	192.000,00	106,53%	EUR	106,53%	516,82	205.050,58	2,7%
SPGB, 0,45%, 31/10/2022, GOVT	560.000,00	101,51%	EUR	101,51%	828,49	569.290,09	7,6%
SPGB, 1,95%, 30/07/2030, GOVT	300.000,00	114,89%	EUR	114,89%	3.413,84	348.071,84	4,6%
SPGB, 4,7%, 30/07/2041, GOVT	35.000,00	168,29%	EUR	168,29%	959,96	59.860,41	0,8%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>3.619.036,26</b>	<b>48,2%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>3.619.036,26</b>	<b>48,2%</b>
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	3.331,00	101,43	EUR	101,43		337.863,33	4,5%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	5.039,00	223,32	EUR	223,32		1.125.309,48	15,0%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	76.414,95	4,48	EUR	4,48		342.392,47	4,6%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	1.371,00	140,12	EUR	140,12		192.104,52	2,6%
ISHARES USD CORP BND EUR-H D (FIM)	15.210,00	5,02	EUR	5,02		76.323,78	1,0%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	1.998,00	170,14	EUR	170,14		339.939,72	4,5%
NORDEA 1 EUR HGH YLD-BI-EUR	2.041,00	39,56	EUR	39,56		80.741,96	1,1%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	6.300,00	178,47	EUR	178,47		1.124.361,00	15,0%
<b>5. Líquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>473.420,46</b>	<b>6,3%</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>473.420,46</b>	<b>6,3%</b>
Depósitos à Ordem						473.420,46	6,3%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-5.816,46</b>	<b>-0,1%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-5.816,46</b>	<b>-0,1%</b>
Juros de D.O. a Regularizar						-16,85	0,0%
Comissões						-5.799,61	-0,1%
<b>VALOR TOTAL DA CARTEIRA</b>						<b>7.515.868,00</b>	
<b>NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>1.080.704,18</b>	
<b>VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>6,95460</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>Acções 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.

<b>Ano</b>	<b>Rendibilidade</b>	<b>Volatilidade</b>	<b>Rend. Anualizada</b>	
<b>2008</b>	1,95%	3,05%	<b>1 Ano</b>	1,95%
<b>2009</b>	4,91%	2,55%	<b>3 Anos</b>	1,25%
<b>2010</b>	-1,11%	3,05%	<b>5 Anos</b>	1,43%
<b>2011</b>	-0,64%	2,74%	<b>Desde o Inicio</b>	2,32%
<b>2012</b>	12,23%	2,39%		
<b>2013</b>	2,43%	1,52%		
<b>2014</b>	5,77%	1,13%		
<b>2015</b>	0,13%	2,43%		
<b>2016</b>	2,45%	1,93%		
<b>2017</b>	0,94%	1,43%		
<b>2018</b>	-1,31%	1,00%		
<b>2019</b>	3,16%	1,41%		
<b>2020</b>	1,95%	2,92%		

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