CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

29 fevereiro 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					**9.231,71**	**4.361.141,99**	**100,0%**
1. Valores Mobiliários Cotados					**9.231,71**	**2.338.070,39**	**53,6%**
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					**9.231,71**	**2.338.070,39**	**53,6%**
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					**9.231,71**	**2.338.070,39**	**53,6%**
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	74.000,00	95,55%	EUR	95,55%	1.368,39	72.077,61	1,7%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	30.000,00	82,50%	EUR	82,50%	70,08	24.820,38	0,6%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	48.000,00	60,82%	EUR	60,82%	405,76	29.597,92	0,7%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	70.000,00	87,72%	EUR	87,72%	1.073,14	62.475,04	1,4%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	126.000,00	74,21%	EUR	74,21%	0,00	93.498,30	2,1%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	179.000,00	51,93%	EUR	51,93%	0,00	92.945,75	2,1%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	250.000,00	90,13%	EUR	90,13%	23,91	225.343,91	5,2%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	219.000,00	93,38%	EUR	93,38%	592,99	205.101,76	4,7%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	320.000,00	83,24%	EUR	83,24%	0,00	266.361,60	6,1%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	49.000,00	83,47%	EUR	83,47%	0,00	40.900,79	0,9%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	93,30%	EUR	93,30%	0,00	18.659,80	0,4%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	137.000,00	96,51%	EUR	96,51%	0,00	132.222,81	3,0%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	250.000,00	93,30%	EUR	93,30%	163,93	233.401,43	5,4%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	101.000,00	53,00%	EUR	53,00%	579,51	54.107,49	1,2%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	70.000,00	85,49%	EUR	85,49%	669,40	60.509,60	1,4%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	77.000,00	91,89%	EUR	91,89%	988,38	71.744,45	1,6%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	48,00%	EUR	48,00%	0,00	16.799,65	0,4%
NETHER,3.75%, 15/01/2042, GOVT	127.000,00	113,07%	EUR	113,07%	585,55	144.189,53	3,3%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	176.000,00	95,37%	EUR	95,37%	0,00	167.858,24	3,8%
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	91.000,00	71,18%	EUR	71,18%	82,05	64.854,03	1,5%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	48.000,00	58,21%	EUR	58,21%	340,33	28.281,61	0,6%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	82,63%	EUR	82,63%	99,18	49.678,38	1,1%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	192.000,00	93,99%	EUR	93,99%	2.189,11	182.640,31	4,2%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						**1.845.880,69**	**42,3%**
3.1. Fundos Harmonizados						**1.845.880,69**	**42,3%**
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	2,00	11.220,45	EUR	11.220,45		22.440,90	0,5%
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1.172,34	101,87	EUR	101,87		119.425,97	2,7%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	2.944,21	207,27	EUR	207,27		610.247,03	14,0%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	26.008,65	4,61	EUR	4,61		120.024,71	2,8%
GROUPAMA MONETAIRE	0,10	221.339,90	EUR	221.339,90		22.133,99	0,5%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	603,00	109,78	EUR	109,78		66.197,34	1,5%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	708,88	169,47	EUR	169,47		120.134,06	2,8%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	3.749,13	163,05	EUR	163,05		611.294,99	14,0%
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1.657,00	92,93	EUR	92,93		153.981,70	3,5%
4. Imobiliário					**0,00**	**153.356,30**	**3,5%**
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						**153.356,30**	**3,5%**
FUNDIMO (FII)	18.057,00	8,49	EUR	8,49		153.356,30	3,5%
5. Liquidez					**0,00**	**25.159,53**	**0,6%**
5.1. À Vista						**25.159,53**	**0,6%**
Depósitos à Ordem						25.159,53	0,6%
9. Outros Activos						**-1.324,93**	**0,0%**
9.1. Outros Devedores E Credores						**-1.324,93**	**0,0%**
Juros de D.O. a Regularizar						-16,85	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	2.034,13	0,0%
Comissões						-3.342,21	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA	**4.361.141,99**
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO	**714.164,64**
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO	**6,11**

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 rendibilidade futura.