

# CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

## INVEST DINÂMICO

30 Junho 2019

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 30/06/2019, 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>2.516,73</b>	<b>1.980.607,19</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>2.516,73</b>	<b>431.467,86</b>	<b>21,8%</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>2.516,73</b>	<b>431.467,86</b>	<b>21,8%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>2.516,73</b>	<b>431.467,86</b>	<b>21,8%</b>
BOTS, CZ, 13/12/2019, GOVT	42.000,00	100,04%	EUR	100,04%	0,00	42.015,96	2,1%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	32.000,00	102,78%	EUR	102,78%	50,71	32.939,67	1,7%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	16.000,00	119,58%	EUR	119,58%	261,26	19.394,54	1,0%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	10.000,00	107,99%	EUR	107,99%	43,70	10.842,50	0,5%
DBR, 1.5%, 15/02/2023, GOVT	74.000,00	108,25%	EUR	108,25%	410,55	80.517,77	4,1%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	16.000,00	105,01%	EUR	105,01%	193,97	16.994,93	0,9%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	20.000,00	121,27%	EUR	121,27%	577,53	24.830,73	1,3%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	40.000,00	101,63%	EUR	101,63%	0,00	40.650,00	2,1%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	20.000,00	109,15%	EUR	109,15%	143,84	21.973,84	1,1%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	21.000,00	107,63%	EUR	107,63%	109,17	22.711,47	1,1%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	100.000,00	102,64%	EUR	102,64%	298,36	102.934,36	5,2%
SPGB, 4.3%, 31/10/2019, GOVT	15.000,00	101,56%	EUR	101,56%	427,64	15.662,09	0,8%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>1.451.544,72</b>	<b>73,3%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>1.451.544,72</b>	<b>73,3%</b>
CAIXGEST ACÇÕES EUROPA, FIM	24.087,86	9,20	EUR	9,20		221.663,70	11,2%
CAIXGEST ACÇÕES PORTUGAL, FIM	9.120,00	12,35	EUR	12,35		112.622,88	5,7%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES LONGO PRAZO, FIM	7.243,00	12,66	EUR	12,66		91.728,97	4,6%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES MAIS, FIM	31.417,00	5,99	EUR	5,99		188.153,27	9,5%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES, FIM	82.555,30	4,47	EUR	4,47		369.212,08	18,6%
ISHARES BARCLAYS CAPITAL EURO INFLATION BO	404,00	214,45	EUR	214,45		86.637,80	4,4%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	2.667,00	139,17	EUR	139,17		371.166,39	18,7%
ISHARES MSCI EMERGING MARKET (FIM)	275,00	42,87	USD	37,67		10.359,62	0,5%
<b>5. Liquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>109.750,79</b>	<b>5,5%</b>
<b>5.1. À Vista</b>					<b>0,00</b>	<b>109.750,79</b>	<b>5,5%</b>
Depósitos à Ordem						109.750,79	5,5%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-12.156,18</b>	<b>-0,6%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-12.156,18</b>	<b>-0,6%</b>
Juros de D.O. a Regularizar						-5,71	0,0%
Impostos a Regularizar						2.471,40	0,1%
Comissões						-14.621,87	-0,7%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA  
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO  
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

1.980.607,19  
318.965,74  
6,2095

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.

<b>Ano</b>	<b>Rendibilidade</b>	<b>Volatilidade</b>	<b>Rend. Anualizada</b>	
<b>2008</b>	-7,99%	3,69%	<b>1 Ano</b>	-5,10%
<b>2009</b>	8,65%	3,73%	<b>3 Anos</b>	-0,42%
<b>2010</b>	-1,57%	4,82%	<b>5 Anos</b>	0,53%
<b>2011</b>	-4,25%	5,67%	<b>Desde o Início</b>	1,31%
<b>2012</b>	12,76%	4,02%		
<b>2013</b>	3,66%	2,66%		
<b>2014</b>	2,94%	2,94%		
<b>2015</b>	1,00%	3,84%		
<b>2016</b>	1,59%	4,49%		
<b>2017</b>	2,44%	1,86%		
<b>2018</b>	-5,10%	3,59%		

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

Não se apresentam valores referentes ao ano de 2019, na medida em que o período em análise é inferior a doze meses.