

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

31 Março 2019

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 31/03/2019, 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
Parte I - Valores Patrimoniais					22.039,22	8.422.754,11	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					22.039,22	3.674.614,15	43,6%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					2.179,79	209.230,79	2,5%
1.1.3. Obrigações Diversas					2.179,79	209.230,79	2,5%
GALP GAS NATURAL, 1.375%, 19/09/2023, CORP	100.000,00	102,12%	EUR	102,12%	727,05	102.846,05	1,2%
REN FINANCE, 1.75%, 01/06/2023, CORP	100.000,00	104,93%	EUR	104,93%	1.452,74	106.384,74	1,3%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					17.444,97	2.954.410,90	35,1%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					8.873,14	2.041.411,57	24,2%
BOTS, CZ, 13/12/2019, GOVT	104.000,00	100,04%	EUR	100,04%	0,00	104.042,64	1,2%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	150.000,00	100,15%	EUR	100,15%	989,01	151.209,51	1,8%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	211.000,00	106,08%	EUR	106,08%	659,01	224.489,92	2,7%
DBR, 1.5%, 15/02/2023, GOVT	324.000,00	108,05%	EUR	108,05%	585,86	350.680,82	4,2%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	90.000,00	105,63%	EUR	105,63%	530,14	95.598,04	1,1%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	92.000,00	121,24%	EUR	121,24%	1.681,84	113.222,64	1,3%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	150.000,00	100,96%	EUR	100,96%	0,00	151.437,00	1,8%
IRISH, 5.9%, 18/10/2019, GOVT	46.000,00	103,49%	EUR	103,49%	1.219,44	48.823,92	0,6%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	100.000,00	106,67%	EUR	106,67%	532,19	107.198,19	1,3%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	100.000,00	105,90%	EUR	105,90%	332,88	106.231,88	1,3%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	494.000,00	102,02%	EUR	102,02%	919,65	504.878,69	6,0%
SPGB, 4.3%, 31/10/2019, GOVT	80.000,00	102,72%	EUR	102,72%	1.423,12	83.598,32	1,0%
1.2.3. Obrigações Diversas					8.571,83	912.999,33	10,8%
AMADEUS, 1.625%, 17/11/2021, CORP, CALL	100.000,00	103,70%	EUR	103,70%	596,57	104.291,57	1,2%
ANZ BANK, 5.125%, 10/09/2019, CORP	50.000,00	102,19%	EUR	102,19%	1.418,15	52.511,65	0,6%
AT&T, 1.45%, 01/06/2022, CORP, CALL)	100.000,00	103,46%	EUR	103,46%	1.203,70	104.667,70	1,2%
EDP FINANCE, 2.625%, 15/04/2019, CORP	100.000,00	100,09%	EUR	100,09%	2.517,12	102.611,12	1,2%
GE CAPITAL FNDNG, 0.8%, 21/01/2022, CORP	100.000,00	100,82%	EUR	100,82%	151,23	100.970,23	1,2%
LLOYDS, 0.75%, 09/11/2021, CORP	102.000,00	101,05%	EUR	101,05%	297,62	103.368,62	1,2%
RABOBANK, 3.75%, 09/11/2020, CORP	100.000,00	105,86%	EUR	105,86%	1.458,90	107.320,90	1,3%
UNIBAIL, 1.375%, 09/03/2026, CORP	100.000,00	104,66%	EUR	104,66%	82,65	104.746,65	1,2%
UNICREDITO ITALIANO, 3.25%, 14/01/2021, CORP	125.000,00	105,33%	EUR	105,33%	845,89	132.510,89	1,6%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					2.414,46	510.972,46	6,1%
1.3.3. Obrigações Diversas					2.414,46	510.972,46	6,1%
BANK OF AMERICA, 0.75%, 26/07/2023, CORP	100.000,00	101,37%	EUR	101,37%	509,59	101.879,59	1,2%
GOLDMAN SACHS, 1.625%, 27/07/2026, CORP	100.000,00	102,60%	EUR	102,60%	1.099,66	103.694,66	1,2%
HONEYWELL, 0.65%, 21/02/2020, CORP	100.000,00	100,65%	EUR	100,65%	67,67	100.717,67	1,2%
PRICELINE GROUP, 0.8%, 10/03/2022, CORP, CALL	100.000,00	102,17%	EUR	102,17%	45,90	102.216,90	1,2%
US BANCORP, 0.85%, 07/06/2024, CORP	100.000,00	101,77%	EUR	101,77%	691,64	102.463,64	1,2%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						4.539.490,09	53,9%
3.1. Fundos Harmonizados						4.539.490,09	53,9%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES LONGO PRAZO, FIM	199.708,00	12,34	EUR	12,34		2.464.356,78	29,3%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES MAIS, FIM	32.231,00	5,93	EUR	5,93		191.274,87	2,3%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES, FIM	423.120,28	4,45	EUR	4,45		1.883.858,43	22,4%
5. Liquidez					0,00	254.109,52	3,0%
5.1. À Vista						254.109,52	3,0%
Depósitos à Ordem						254.109,52	3,0%
9. Outros Activos						-45.459,65	-0,5%
9.1. Outros Devedores E Credores						-45.459,65	-0,5%
Juros de D.O. a Regularizar						-14,01	0,0%
Comissões						-45.445,64	-0,5%

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

8.422.754,11
1.241.357,6078
6,78511

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	Rend. Anualizada	
2008	1,95%	3,05%	1 Ano	-1,31%
2009	4,91%	2,55%	3 Anos	0,68%
2010	-1,11%	3,05%	5 Anos	1,57%
2011	-0,64%	2,74%	Desde o Inicio	2,28%
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%		

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

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