

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

30 abril 2023

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)
Parte I - Valores Patrimoniais					12,389.39	4,705,248.43
1. Valores Mobiliários Cotados					12,389.39	2,500,991.87
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					12,389.39	2,500,991.87
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					11,683.77	2,447,919.77
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	180,000.00	93.93%	EUR	93.93%	4,047.78	173,123.58
BKO, 0.2%, 24/06/2024, GOVT	271,000.00	97.09%	EUR	97.09%	513.79	263,633.11
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	48,000.00	56.61%	EUR	56.61%	133.04	27,303.92
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	126,000.00	72.61%	EUR	72.61%	0.00	91,486.08
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	179,000.00	52.78%	EUR	52.78%	0.00	94,467.25
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	219,000.00	92.45%	EUR	92.45%	774.00	203,230.74
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	320,000.00	81.77%	EUR	81.77%	0.00	261,676.80
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	49,000.00	80.50%	EUR	80.50%	0.00	39,445.49
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20,000.00	91.22%	EUR	91.22%	0.00	18,243.80
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	137,000.00	94.74%	EUR	94.74%	0.00	129,792.43
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	250,000.00	91.68%	EUR	91.68%	267.12	229,472.12
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	50,000.00	83.50%	EUR	83.50%	582.19	42,329.69
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	77,000.00	90.71%	EUR	90.71%	122.13	69,969.60
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35,000.00	47.80%	EUR	47.80%	0.00	16,728.95
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	165,000.00	113.62%	EUR	113.62%	1,779.97	189,259.57
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	58,000.00	91.13%	EUR	91.13%	344.42	53,198.66
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	242,000.00	93.86%	EUR	93.86%	0.00	227,136.36
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	91,000.00	68.54%	EUR	68.54%	119.67	62,486.52
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	48,000.00	56.73%	EUR	56.73%	40.33	27,268.81
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60,000.00	79.69%	EUR	79.69%	148.77	47,960.37
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	192,000.00	92.13%	EUR	92.13%	2,810.56	179,705.92
1.2.3. Obrigações Diversas					705.62	53,072.10
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	101,000.00	51.85%	EUR	51.85%	705.62	53,072.10
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1,939,160.17
3.1. Fundos Harmonizados						1,939,160.17
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1,305.36	97.74	EUR	97.74		127,585.59
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	3,364.47	195.10	EUR	195.10		656,407.32
CAIXGEST OBRIGAÇÕES, FIM	29,375.41	4.37	EUR	4.37		128,335.31
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	669.00	107.14	EUR	107.14		71,676.66
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	789.59	162.00	EUR	162.00		127,914.23
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	4,277.27	153.96	EUR	153.96		658,528.64
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1,717.00	98.26	EUR	98.26		168,712.42
4. Imobiliário					0.00	151,070.28
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						151,070.28
FUNDIMO (FII)	18,057.00	8.37	EUR	8.37		151,070.28
5. Liquidez					0.00	117,797.92
5.1. À Vista						117,797.92
Depósitos à Ordem						117,797.92
9. Outros Activos						-3,771.82
9.1. Outros Devedores E Credores						-3,771.82
Juros de D.O. a Regularizar						-16.85
Comissões						-3,754.97
VALOR TOTAL DA CARTEIRA						4,705,248.43
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO						789,850.69
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO						5.95714

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	-14,71%
2009	4,91%	2,55%	3 Anos	-5,21%
2010	-1,11%	3,05%	5 Anos	-2,81%
2011	-0,64%	2,74%	Desde o Inicio	0,96%
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%		

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