

# CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

## INVEST EQUILIBRADO

31 agosto 2022

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 agosto 2022, 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>3.447,22</b>	<b>5.523.296,19</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>3.447,22</b>	<b>2.569.242,95</b>	<b>46,5%</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>3.447,22</b>	<b>2.569.242,95</b>	<b>46,5%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>3.336,47</b>	<b>2.535.151,55</b>	<b>45,9%</b>
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	80.000,00	101,30%	EUR	101,30%	526,03	81.564,43	1,5%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	50.000,00	63,08%	EUR	63,08%	422,69	31.961,19	0,6%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	376.000,00	79,92%	EUR	79,92%	0,00	300.480,40	5,4%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	185.000,00	63,79%	EUR	63,79%	0,00	118.004,10	2,1%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	240.000,00	96,15%	EUR	96,15%	52,60	230.800,60	4,2%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	420.000,00	86,93%	EUR	86,93%	0,00	365.110,20	6,6%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	52.000,00	83,96%	EUR	83,96%	0,00	43.661,28	0,8%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	92,96%	EUR	92,96%	0,00	18.591,60	0,3%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	150.000,00	96,47%	EUR	96,47%	0,00	144.702,00	2,6%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	400.000,00	94,60%	EUR	94,60%	764,38	379.164,38	6,9%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	80.000,00	95,36%	EUR	95,36%	491,18	76.777,58	1,4%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	56,21%	EUR	56,21%	0,00	19.673,50	0,4%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	20.000,00	127,47%	EUR	127,47%	468,49	25.962,89	0,5%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	20.000,00	95,17%	EUR	95,17%	19,32	19.053,92	0,3%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	400.000,00	96,42%	EUR	96,42%	0,00	385.668,00	7,0%
RAGB, 0%, 15/07/2023, GOVT	50.000,00	99,21%	EUR	99,21%	0,00	49.603,50	0,9%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	83,31%	EUR	83,31%	249,86	50.234,06	0,9%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	200.000,00	96,90%	EUR	96,90%	341,92	194.137,92	3,5%
<b>1.2.3. Obrigações Diversas</b>					<b>110,75</b>	<b>34.091,40</b>	<b>0,6%</b>
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	55.000,00	61,78%	EUR	61,78%	110,75	34.091,40	0,6%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>2.682.359,42</b>	<b>48,6%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>2.682.359,42</b>	<b>48,6%</b>
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	2.563,01	97,55	EUR	97,55		250.021,43	4,5%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	4.240,78	196,14	EUR	196,14		831.786,79	15,1%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES, FIM	58.297,29	4,32	EUR	4,32		251.564,48	4,6%
ISHARES USD HY CORP EUR-H D, FIM	28.452,00	4,06	EUR	4,06		115.600,48	2,1%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	1.563,47	161,93	EUR	161,93		253.172,37	4,6%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	5.377,44	155,59	EUR	155,59		836.675,58	15,1%
XTRAKERS II EUR HIGH YIELD CO, GY	9.711,00	14,78	EUR	14,78		143.538,29	2,6%
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>147.762,24</b>	<b>2,7%</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>						<b>147.762,24</b>	<b>2,7%</b>
FUNDIMO (FII)	18.057,00	8,18	EUR	8,18		147.762,24	2,7%
<b>5. Liquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>128.534,89</b>	<b>2,3%</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>128.534,89</b>	<b>2,3%</b>
Depósitos à Ordem						128.534,89	2,3%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-4.603,32</b>	<b>-0,1%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-4.603,32</b>	<b>-0,1%</b>
Juros de D.O. a Regularizar						-16,85	0,0%
Comissões						-4.586,47	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

5.523.296,19

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

899.446,15

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6,14077

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.

<b>Ano</b>	<b>Rendibilidade</b>	<b>Volatilidade</b>	<b>Rend. Anualizada</b>	
<b>2008</b>	1,95%	3,05%	<b>1 Ano</b>	-2,05%
<b>2009</b>	4,91%	2,55%	<b>3 Anos</b>	0,99%
<b>2010</b>	-1,11%	3,05%	<b>5 Anos</b>	0,52%
<b>2011</b>	-0,64%	2,74%	<b>Desde o Inicio</b>	2,04%
<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%	2,90%		
<b>2021</b>	-2,05%	1,58%		

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