

# CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

## INVEST EQUILIBRADO

31 outubro 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)	Peso
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>9.494,29</b>	<b>4.435.413,29</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>9.494,29</b>	<b>2.241.703,06</b>	<b>50,5%</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>9.494,29</b>	<b>2.241.703,06</b>	<b>50,5%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>9.494,29</b>	<b>2.241.703,06</b>	<b>50,5%</b>
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	74.000,00	90,63%	EUR	90,63%	781,25	67.845,97	1,5%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	48.000,00	51,54%	EUR	51,54%	134,51	24.871,79	0,6%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	126.000,00	69,29%	EUR	69,29%	0,00	87.309,18	2,0%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	179.000,00	44,97%	EUR	44,97%	0,00	80.487,35	1,8%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	250.000,00	88,50%	EUR	88,50%	441,78	221.701,78	5,0%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	219.000,00	92,32%	EUR	92,32%	230,61	202.407,03	4,6%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	320.000,00	80,14%	EUR	80,14%	0,00	256.454,40	5,8%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	49.000,00	80,03%	EUR	80,03%	0,00	39.216,66	0,9%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	91,94%	EUR	91,94%	0,00	18.387,00	0,4%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	137.000,00	95,50%	EUR	95,50%	0,00	130.836,37	2,9%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	250.000,00	91,92%	EUR	91,92%	582,19	230.384,69	5,2%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	101.000,00	44,84%	EUR	44,84%	329,08	45.612,43	1,0%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	50.000,00	80,65%	EUR	80,65%	271,52	40.597,02	0,9%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	77.000,00	88,39%	EUR	88,39%	644,72	68.704,25	1,5%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	40,75%	EUR	40,75%	0,00	14.261,10	0,3%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	165.000,00	105,08%	EUR	105,08%	4.899,14	178.274,54	4,0%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	242.000,00	94,39%	EUR	94,39%	0,00	228.423,80	5,2%
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	91.000,00	65,51%	EUR	65,51%	6,84	59.618,21	1,3%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	48.000,00	49,86%	EUR	49,86%	221,31	24.152,67	0,5%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	78,46%	EUR	78,46%	0,00	47.073,00	1,1%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	192.000,00	90,69%	EUR	90,69%	951,34	175.083,82	3,9%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>1.933.467,34</b>	<b>43,6%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>1.933.467,34</b>	<b>43,6%</b>
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1.243,17	99,64	EUR	99,64		123.869,66	2,8%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	3.184,08	197,32	EUR	197,32		628.283,26	14,2%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	27.549,49	4,49	EUR	4,49		123.766,11	2,8%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	649,00	105,35	EUR	105,35		68.372,15	1,5%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	749,13	164,42	EUR	164,42		123.171,95	2,8%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	4.050,93	153,57	EUR	153,57		622.101,32	14,0%
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	2.695,00	90,50	EUR	90,50		243.902,89	5,5%
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>152.718,88</b>	<b>3,4%</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>						<b>152.718,88</b>	<b>3,4%</b>
FUNDIMO (FIL)	18.057,00	8,46	EUR	8,46		152.718,88	3,4%
<b>5. Liquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>111.111,76</b>	<b>2,5%</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>111.111,76</b>	<b>2,5%</b>
Depósitos à Ordem						111.111,76	2,5%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-3.587,76</b>	<b>-0,1%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-3.587,76</b>	<b>-0,1%</b>
Juros de D.O. a Regularizar						-16,85	0,0%
Comissões						-3.570,91	-0,1%
<b>VALOR TOTAL DA CARTEIRA</b>						<b>4.435.413,29</b>	
<b>NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>757.001,59</b>	
<b>VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>5,86</b>	

O Fundo Autónomo de Investimento da opção de investimento Invest Equilibrado-ICAE será composto pela seguinte carteira de activos:

Composição do Fundo	Invest Equilibrado
<b>Acções e outras Participações de Rendimento Variável</b>	Máximo 10%
<b>Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Fixa</b>	20% - 80%
<b>Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Variável e Depósitos em Instituições de Crédito</b>	10% - 80%
<b>Instrumentos de Retorno Absoluto e outras Classes de Activos</b>	Máximo 5%
<b>Imobiliário</b>	Máximo 20%
<b>Tipo de Risco da Opção</b>	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>	-14,71%
<b>2009</b>	4,91%	2,55%	<b>3 Anos</b>	-5,21%
<b>2010</b>	-1,11%	3,05%	<b>5 Anos</b>	-2,81%
<b>2011</b>	-0,64%	2,74%	<b>Desde o Inicio</b>	0,96%
<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%		
<b>2022</b>	-14,71%	6,24%		

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