

# CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

## INVEST EQUILIBRADO

31 dezembro 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 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)
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>7.063,79</b>	<b>5.114.823,15</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>7.063,79</b>	<b>2.547.083,74</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>7.063,79</b>	<b>2.547.083,74</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>6.815,16</b>	<b>2.518.142,16</b>
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	80.000,00	93,28%	EUR	93,28%	1.167,78	75.794,98
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	50.000,00	55,57%	EUR	55,57%	284,12	28.066,62
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	376.000,00	70,97%	EUR	70,97%	0,00	266.854,72
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	185.000,00	52,18%	EUR	52,18%	0,00	96.529,30
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	240.000,00	91,50%	EUR	91,50%	453,70	220.044,10
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	420.000,00	79,94%	EUR	79,94%	0,00	335.756,40
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	52.000,00	79,29%	EUR	79,29%	0,00	41.232,88
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	90,17%	EUR	90,17%	0,00	18.034,80
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	150.000,00	94,01%	EUR	94,01%	0,00	141.021,00
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	400.000,00	90,82%	EUR	90,82%	98,63	363.358,63
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	80.000,00	89,03%	EUR	89,03%	852,16	72.072,96
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	35.000,00	48,46%	EUR	48,46%	0,00	16.961,00
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	20.000,00	113,48%	EUR	113,48%	719,18	23.415,58
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	360.000,00	90,28%	EUR	90,28%	1.250,13	326.247,33
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	250.000,00	93,36%	EUR	93,36%	0,00	233.410,00
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	50.000,00	57,57%	EUR	57,57%	293,84	29.076,84
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	60.000,00	77,81%	EUR	77,81%	50,14	46.735,54
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	200.000,00	90,94%	EUR	90,94%	1.645,48	183.529,48
					<b>248,63</b>	<b>28.941,58</b>
<b>1.2.3. Obrigações Diversas</b>						
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	55.000,00	52,17%	EUR	52,17%	248,63	28.941,58
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>2.219.855,35</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>2.219.855,35</b>
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	1.408,69	96,76	EUR	96,76		136.304,75
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	3.647,07	191,26	EUR	191,26		697.538,80
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	31.563,74	4,30	EUR	4,30		135.818,77
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	721,00	106,99	EUR	106,99		77.139,79
ISHARES USD HY CORP EUR-H D, FIM, ETF	26.990,00	3,92	EUR	3,92		105.834,54
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	850,24	161,21	EUR	161,21		137.067,19
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	4.577,91	151,48	EUR	151,48		693.461,05
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1.078,00	96,50	EUR	96,50		104.027,00
XTRAKERS II EUR HIGH YIELD CO, GY, ETF	8.846,00	15,00	EUR	15,00		132.663,46
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>148.899,83</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>						<b>148.899,83</b>
FUNDIMO (FI)	18.057,00	8,25	EUR	8,25		148.899,83
<b>5. Liquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>203.231,81</b>
<b>5.1. À Vista</b>						<b>203.231,81</b>
Depósitos à Ordem						203.231,81
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-4.247,59</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-4.247,59</b>
Juros de D.O. a Regularizar						-16,85
Comissões						-4.230,74

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

5.114.823,15  
871.116,32  
5,87157

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>	-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.