

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

30 Setembro 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 30/09/2019, 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					36.188,10	8.491.985,46	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					36.188,10	3.591.217,42	42,3%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					619,88	211.689,88	2,5%
1.1.3. Obrigações Diversas					619,88	211.689,88	2,5%
GALP GAS NATURAL, 1.375%, 19/09/2023, CORP	100.000,00	104,53%	EUR	104,53%	41,33	104.575,33	1,2%
REN FINANCE, 1.75%, 01/06/2023, CORP	100.000,00	106,54%	EUR	106,54%	578,55	107.114,55	1,3%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					33.354,37	2.653.530,69	31,2%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					23.717,68	1.994.666,74	23,5%
BOTS, CZ, 13/12/2019, GOVT	104.000,00	100,07%	EUR	100,07%	0,00	104.068,64	1,2%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	270.000,00	109,76%	EUR	109,76%	1.785,25	298.139,95	3,5%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	43.000,00	138,04%	EUR	138,04%	282,74	59.639,08	0,7%
DBR, 2,5%, 04/01/2021, GOVT	550.000,00	104,26%	EUR	104,26%	10.133,57	583.580,07	6,9%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	138.000,00	105,21%	EUR	105,21%	292,07	145.479,11	1,7%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	92.000,00	120,43%	EUR	120,43%	3.642,19	114.437,79	1,3%
IRISH, 5.9%, 18/10/2019, GOVT	66.000,00	100,26%	EUR	100,26%	3.701,97	69.876,21	0,8%
SPGB, 0,45%, 31/10/2022, GOVT	560.000,00	102,75%	EUR	102,75%	2.305,97	577.722,77	6,8%
SPGB, 4.3%, 31/10/2019, GOVT	40.000,00	100,37%	EUR	100,37%	1.573,92	41.723,12	0,5%
1.2.3. Obrigações Diversas					9.636,69	658.863,95	7,8%
AMADEUS, 1.625%, 17/11/2021, CORP, CALL	100.000,00	103,17%	EUR	103,17%	1.411,30	104.579,30	1,2%
GE CAPITAL FNDNG, 0.8%, 21/01/2022, CORP	100.000,00	100,72%	EUR	100,72%	552,33	101.269,33	1,2%
LLOYDS, 0.75%, 09/11/2021, CORP	102.000,00	101,54%	EUR	101,54%	681,16	104.249,92	1,2%
RABOBANK, 3.75%, 09/11/2020, CORP	100.000,00	104,05%	EUR	104,05%	3.339,04	107.392,04	1,3%
UNIBAIL, 1.375%, 09/03/2026, CORP	100.000,00	107,27%	EUR	107,27%	770,15	108.043,15	1,3%
UNICREDITO ITALIANO, 3.25%, 14/01/2021, CORP	125.000,00	104,36%	EUR	104,36%	2.882,71	133.330,21	1,6%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					2.213,85	725.996,85	8,5%
1.3.1. Títulos De Dívida Pública					204,10	105.024,10	1,2%
CHILE, 0.83%, 02/07/2031, GOVT, CALL	100.000,00	104,82%	EUR	104,82%	204,10	105.024,10	1,2%
1.3.3. Obrigações Diversas					2.009,75	620.972,75	7,3%
AT&T, 1.45%, 01/06/2022, CORP, CALL	100.000,00	103,45%	EUR	103,45%	479,37	103.932,37	1,2%
BANK OF AMERICA, 0.75%, 26/07/2023, CORP	100.000,00	102,55%	EUR	102,55%	135,25	102.680,25	1,2%
GOLDMAN SACHS, 1.625%, 27/07/2026, CORP	100.000,00	107,05%	EUR	107,05%	288,59	107.341,59	1,3%
HONEYWELL, 0.65%, 21/02/2020, CORP	100.000,00	100,29%	EUR	100,29%	393,56	100.684,56	1,2%
PRICELINE GROUP, 0.8%, 10/03/2022, CORP, CALL	100.000,00	102,00%	EUR	102,00%	445,90	102.449,90	1,2%
US BANCORP, 0.85%, 07/06/2024, CORP	100.000,00	103,62%	EUR	103,62%	267,08	103.884,08	1,2%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						4.494.262,69	52,9%
3.1. Fundos Harmonizados						4.494.262,69	52,9%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES LONGO PRAZO, FIM	147.708,00	13,09	EUR	13,09		1.933.364,79	22,8%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES MAIS, FIM	32.231,00	6,01	EUR	6,01		193.598,72	2,3%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	528.120,28	4,48	EUR	4,48		2.367.299,17	27,9%
5. Liquidez					0,00	472.876,21	5,6%
5.1. À Vista						472.876,21	5,6%
Depósitos à Ordem						472.876,21	5,6%
9. Outros Activos						-66.370,86	-0,8%
9.1. Outros Devedores E Credores						-66.370,86	-0,8%
Juros de D.O. a Regularizar						-14,01	0,0%
Comissões						-66.356,85	-0,8%
VALOR TOTAL DA CARTEIRA						8.491.985,46	
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO						1.218.956,33	
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO						6,96660	

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 rendibilidade futura.

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