

# CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

## INVEST DINÂMICO

31 maio 2020

O produto CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA – Invest + Dinâmico teve o início de comercialização em 20/02/2006. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31/05/2020, 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>2.300,55</b>	<b>1.788.673,45</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>2.300,55</b>	<b>402.991,90</b>	<b>22,5%</b>
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>2.300,55</b>	<b>402.991,90</b>	<b>22,5%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>2.300,55</b>	<b>402.991,90</b>	<b>22,5%</b>
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	14.000,00	127,65%	EUR	127,65%	183,61	18.054,47	1,0%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	50.000,00	107,94%	EUR	107,94%	198,29	54.169,79	3,0%
DBR, 1.5%, 15/02/2023, GOVT	3.000,00	105,91%	EUR	105,91%	13,03	3.190,30	0,2%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	102.000,00	101,85%	EUR	101,85%	1.031,15	104.922,23	5,9%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	38.000,00	103,56%	EUR	103,56%	48,80	39.401,60	2,2%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	9.000,00	116,49%	EUR	116,49%	228,87	10.713,06	0,6%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	5.000,00	100,93%	EUR	100,93%	0,00	5.046,50	0,3%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	18.000,00	109,16%	EUR	109,16%	118,40	19.766,48	1,1%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	18.000,00	106,99%	EUR	106,99%	82,62	19.340,64	1,1%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	120.000,00	101,90%	EUR	101,90%	314,26	122.594,26	6,9%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	5.000,00	114,22%	EUR	114,22%	81,52	5.792,57	0,3%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>1.314.693,78</b>	<b>73,5%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>1.314.693,78</b>	<b>73,5%</b>
CAIXA OBRIGAÇÕES LONGO PRAZO, FIM	4.863,00	12,78	EUR	12,78		62.148,17	3,5%
CAIXAGEST ACÇÕES EUROPA, FIM	20.547,86	8,97	EUR	8,97		184.351,27	10,3%
CAIXAGEST ACÇÕES PORTUGAL, FIM	8.060,00	9,63	EUR	9,63		77.657,29	4,3%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES MAIS, FIM	10.369,37	5,71	EUR	5,71		59.234,02	3,3%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	104.555,30	4,37	EUR	4,37		456.561,64	25,5%
HYPO DOW DJ EURO STOXX 50 ETF, FIM	2.693,00	30,96	EUR	30,96		83.361,82	4,7%
INVESTECS GS EUROPEAN EQ-IA	38,00	27,52	EUR	27,52		1.045,76	0,1%
ISHARES BARCLAYS CAPITAL EURO INFLATION BOND (FIM)	260,00	210,73	EUR	210,73		54.789,80	3,1%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	2.460,00	136,40	EUR	136,40		335.544,00	18,8%
<b>5. Liquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>71.820,05</b>	<b>4,0%</b>
<b>5.1. À Vista</b>					<b>0,00</b>	<b>71.820,05</b>	<b>4,0%</b>
Depósitos à Ordem						71.820,05	4,0%
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-832,28</b>	<b>0,0%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-832,28</b>	<b>0,0%</b>
Juros de D.O. a Regularizar						-5,71	0,0%
Comissões						-826,57	0,0%

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

1.788.673,45  
295.495,29  
6,0531

O Fundo Autónomo de Investimento da opção de investimento Invest + Dinâmico – ICAE é composto pela seguinte carteira de activos:

Composição do Fundo	Invest + Dinâmico
<b>Ações e outras Participações de Rendimento Variável</b>	5% - 30%
<b>Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Fixa</b>	10% - 65%
<b>Títulos de Rendimento Fixo de Taxa Variável e Depósitos em Instituições de Crédito</b>	40% - 85%
<b>Instrumentos de Retorno Absoluto e outras Classes de Activos</b>	Máximo 20%
<b>Imobiliário</b>	Máximo 20%
<b>Tipo de Risco da Opção</b>	Médio/Elevado

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>	-7,99%	3,69%	<b>1 Ano</b>	6,55%
<b>2009</b>	8,65%	3,73%	<b>3 Anos</b>	1,18%
<b>2010</b>	-1,57%	4,82%	<b>5 Anos</b>	1,23%
<b>2011</b>	-4,25%	5,67%	<b>Desde o Início</b>	1,68%
<b>2012</b>	12,76%	4,02%		
<b>2013</b>	3,66%	2,66%		
<b>2014</b>	2,94%	2,94%		
<b>2015</b>	1,00%	3,84%		
<b>2016</b>	1,59%	4,49%		
<b>2017</b>	2,44%	1,86%		
<b>2018</b>	-5,10%	3,59%		
<b>2019</b>	6,55%	2,32%		

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

Não se apresentam valores referentes ao ano de 2020, na medida em que o período em análise é inferior a doze meses.