

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE
INVEST EQUILIBRADO

31 maio 2020

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 31/05/2020, 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
Parte I - Valores Patrimoniais					22.119,84	7.849.092,86	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					22.119,84	3.215.652,49	41,0%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					2.703,21	204.723,21	2,6%
1.1.3. Obrigações Diversas					2.703,21	204.723,21	2,6%
GALP GAS NATURAL, 1.375%, 19/09/2023, CORP	100.000,00	99,42%	EUR	99,42%	957,99	100.378,99	1,3%
REN FINANCE, 1.75%, 01/06/2023, CORP	100.000,00	102,60%	EUR	102,60%	1.745,22	104.344,22	1,3%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					14.949,94	2.502.268,59	31,9%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					9.432,40	1.870.369,90	23,8%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	70.000,00	105,16%	EUR	105,16%	696,17	74.310,97	0,9%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	43.000,00	127,65%	EUR	127,65%	563,93	55.453,00	0,7%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	190.000,00	106,78%	EUR	106,78%	137,57	203.019,57	2,6%
DBR, 1.5%, 15/02/2023, GOVT	70.000,00	105,91%	EUR	105,91%	304,10	74.440,40	0,9%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	352.000,00	101,85%	EUR	101,85%	3.558,47	362.084,55	4,6%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	170.000,00	103,56%	EUR	103,56%	218,31	176.270,31	2,2%
FRTR, 3%, 25/04/2022, GOVT	95.000,00	106,73%	EUR	106,73%	281,10	101.673,65	1,3%
NETHER, 2.25%, 15/07/2022, GOVT	50.000,00	106,09%	EUR	106,09%	986,68	54.031,18	0,7%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	80.000,00	109,16%	EUR	109,16%	526,23	87.851,03	1,1%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	80.000,00	106,99%	EUR	106,99%	367,21	85.958,41	1,1%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	560.000,00	101,90%	EUR	101,90%	1.466,56	572.106,56	7,3%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	20.000,00	114,22%	EUR	114,22%	326,07	23.170,27	0,3%
1.2.3. Obrigações Diversas					5.517,54	631.898,69	8,1%
AMADEUS, 1.625%, 17/11/2021, CORP, CALL	100.000,00	100,07%	EUR	100,07%	870,22	100.942,22	1,3%
GE CAPITAL FNDNG, 0.8%, 21/01/2022, CORP	100.000,00	99,42%	EUR	99,42%	286,34	99.701,34	1,3%
LLOYDS, 0.75%, 09/11/2021, CORP	102.000,00	99,57%	EUR	99,57%	426,39	101.987,79	1,3%
RABOBANK, 3.75%, 09/11/2020, CORP	100.000,00	101,21%	EUR	101,21%	2.090,16	103.302,16	1,3%
UNIBAIL, 1.375%, 09/03/2026, CORP	100.000,00	97,10%	EUR	97,10%	312,67	97.409,67	1,2%
UNICREDITO ITALIANO, 3.25%, 14/01/2021, CORP	125.000,00	101,62%	EUR	101,62%	1.531,76	128.555,51	1,6%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					4.466,69	508.660,69	6,5%
1.3.3. Obrigações Diversas					4.466,69	508.660,69	6,5%
AT&T, 1.45%, 01/06/2022, CORP, CALL	100.000,00	101,40%	EUR	101,40%	1.446,04	102.844,04	1,3%
BANK OF AMERICA, 0.75%, 26/07/2023, CORP	100.000,00	100,43%	EUR	100,43%	635,25	101.063,25	1,3%
GOLDMAN SACHS, 1.625%, 27/07/2026, CORP	100.000,00	103,15%	EUR	103,15%	1.371,93	104.519,93	1,3%
PRICELINE GROUP, 0.8%, 10/03/2022, CORP, CALL	100.000,00	99,13%	EUR	99,13%	179,73	99.312,73	1,3%
US BANCORP, 0.85%, 07/06/2024, CORP	100.000,00	100,09%	EUR	100,09%	833,74	100.920,74	1,3%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						4.377.937,91	55,8%
3.1. Fundos Harmonizados						4.377.937,91	55,8%
CAIXA OBRIGAÇÕES LONGO PRAZO, FIM	147.708,00	12,78	EUR	12,78		1.887.678,70	24,0%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES MAIS, FIM	32.231,00	5,71	EUR	5,71		184.116,36	2,3%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	528.120,28	4,37	EUR	4,37		2.306.142,84	29,4%
5. Liquidez					0,00	258.513,28	3,3%
5.1. À Vista						258.513,28	3,3%
Depósitos à Ordem						258.513,28	3,3%
9. Outros Activos						-3.010,82	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores						-3.010,82	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						-16,85	0,0%
Comissões						-2.993,97	0,0%
VALOR TOTAL DA CARTEIRA						7.849.092,86	
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO						1.153.583,42	
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO						6,80410	

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

Composição do Fundo	Invest Equilibrado
Ações 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	3,16%
2009	4,91%	2,55%	3 Anos	0,92%
2010	-1,11%	3,05%	5 Anos	1,06%
2011	-0,64%	2,74%	Desde o Inicio	2,35%
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%		
2019	3,16%	1,41%		

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.