

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST DINÂMICO

31 dezembro 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 31/12/2020, 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 | | | | | 0,00 | 1.881.774,83 | 100,0% |
| 3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo | | | | | | 1.857.218,55 | 98,7% |
| 3.1. Fundos Harmonizados | | | | | | 1.857.218,55 | 98,7% |
| AB SCV I-EURO EQ PTF-IE (FIM) | 3.202,00 | 29,96 | EUR | 29,96 | | 95.931,92 | 5,1% |
| ALLIANZ EUOLD EQY GROW - IT | 30,00 | 3.280,70 | EUR | 3.280,70 | | 98.421,00 | 5,2% |
| BLUEBAY INVEST GR EURO GV-I (FIM) | 1.712,00 | 191,73 | EUR | 191,73 | | 328.241,76 | 17,4% |
| BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM) | 1.734,00 | 223,97 | EUR | 223,97 | | 388.363,98 | 20,6% |
| ISHARES EURO CORPORATE (FIM) | 394,00 | 142,07 | EUR | 142,07 | | 55.975,58 | 3,0% |
| ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM) | 514,00 | 39,83 | EUR | 39,83 | | 20.472,62 | 1,1% |
| ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM) | 125,00 | 81,30 | EUR | 81,30 | | 10.162,50 | 0,5% |
| ISHARES USD CORP BND EUR-H D (FIM) | 3.511,00 | 5,27 | EUR | 5,27 | | 18.504,73 | 1,0% |
| JPMORGAN F-EU GOVER BOND-I (FIM) | 2.390,00 | 137,14 | EUR | 137,14 | | 327.769,38 | 17,4% |
| NORDEA 1 EUR HGH YLD-BI-EUR | 740,00 | 39,18 | EUR | 39,18 | | 28.993,20 | 1,5% |
| SCHRODER INTL EURO EQT-C ACC (FIM) | 2.058,00 | 46,46 | EUR | 46,46 | | 95.616,12 | 5,1% |
| VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM) | 2.168,00 | 179,32 | EUR | 179,32 | | 388.765,76 | 20,7% |
| 5. Liquidez | | | | | 0,00 | 26.153,71 | 1,4% |
| 5.1. À Vista | | | | | 0,00 | 26.153,71 | 1,4% |
| Depósitos à Ordem | | | | | | 26.153,71 | 1,4% |
| 9. Outros Activos | | | | | | -1.597,43 | -0,1% |
| 9.1. Outros Devedores E Credores | | | | | | -1.597,43 | -0,1% |
| Juros de D.O. a Regularizar | | | | | | -5,71 | 0,0% |
| Comissões | | | | | | -1.591,72 | -0,1% |

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

1.881.774,83
290.921,02
6,4683

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

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

| Ano | Rendibilidade | Volatilidade | Rend. Anualizada | |
|-------------|----------------------|---------------------|-------------------------|-------|
| 2008 | -7,99% | 3,69% | 1 Ano | 2,66% |
| 2009 | 8,65% | 3,73% | 3 Anos | 1,25% |
| 2010 | -1,57% | 4,82% | 5 Anos | 1,56% |
| 2011 | -4,25% | 5,67% | Desde o Inicio | 1,75% |
| 2012 | 12,76% | 4,02% | | |
| 2013 | 3,66% | 2,66% | | |
| 2014 | 2,94% | 2,94% | | |
| 2015 | 1,00% | 3,84% | | |
| 2016 | 1,59% | 4,49% | | |
| 2017 | 2,44% | 1,86% | | |
| 2018 | -5,10% | 3,59% | | |
| 2019 | 6,55% | 2,32% | | |
| 2020 | 2,66% | 7,79% | | |

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