

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

31 dezembro 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 31/12/2020, 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					19.172,85	7.603.301,28	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					19.172,85	3.495.149,53	46,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					19.172,85	3.495.149,53	46,0%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					19.172,85	3.495.149,53	46,0%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	470.000,00	110,21%	EUR	110,21%	774,73	518.752,33	6,8%
BTPS, 3.45%, 01/03/2048, GOVT	80.000,00	147,42%	EUR	147,42%	914,96	118.846,96	1,6%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	188.000,00	144,60%	EUR	144,60%	3.131,62	274.975,86	3,6%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	10.000,00	107,54%	EUR	107,54%	21,86	10.776,26	0,1%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	20.000,00	108,22%	EUR	108,22%	37,77	21.682,37	0,3%
DBR, 1.5%, 15/02/2023, GOVT	265.000,00	104,80%	EUR	104,80%	3.475,41	281.184,81	3,7%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	168.000,00	100,00%	EUR	100,00%	4.154,10	172.157,46	2,3%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	52.000,00	104,15%	EUR	104,15%	0,00	54.155,92	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	485.000,00	105,10%	EUR	105,10%	119,59	509.859,44	6,7%
FRTR, 2%, 25/05/2048, GOVT	60.000,00	145,61%	EUR	145,61%	723,29	88.088,69	1,2%
FRTR, 3%, 25/04/2022, GOVT	95.000,00	104,84%	EUR	104,84%	1.952,05	101.549,10	1,3%
RAGB, 0%, 15/07/2023, GOVT	140.000,00	101,67%	EUR	101,67%	0,00	142.338,00	1,9%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	192.000,00	108,18%	EUR	108,18%	284,05	207.995,41	2,7%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	560.000,00	101,89%	EUR	101,89%	421,15	571.005,15	7,5%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	300.000,00	118,63%	EUR	118,63%	2.468,22	358.364,22	4,7%
SPGB, 4.7%, 30/07/2041, GOVT	35.000,00	179,21%	EUR	179,21%	694,05	63.417,55	0,8%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						3.632.142,77	47,8%
3.1. Fundos Harmonizados						3.632.142,77	47,8%
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	3.331,00	101,43	EUR	101,43		337.863,33	4,4%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	5.039,00	223,97	EUR	223,97		1.128.584,83	14,8%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	76.414,95	4,48	EUR	4,48		342.468,89	4,5%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	1.371,00	142,07	EUR	142,07		194.777,97	2,6%
ISHARES USD CORP BND EUR-H D (FIM)	15.210,00	5,27	EUR	5,27		80.164,31	1,1%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	1.998,00	169,47	EUR	169,47		338.601,06	4,5%
NORDEA 1 EUR HGH YLD-BI-EUR	2.041,00	39,18	EUR	39,18		79.966,38	1,1%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	6.300,00	179,32	EUR	179,32		1.129.716,00	14,9%
5. Liquidez					0,00	482.481,73	6,3%
5.1. À Vista						482.481,73	6,3%
Depósitos à Ordem						482.481,73	6,3%
9. Outros Activos						-6.472,76	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores						-6.472,76	-0,1%
Juros de D.O. a Regularizar						-16,85	0,0%
Comissões						-6.455,91	-0,1%
VALOR TOTAL DA CARTEIRA						7.603.301,28	
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO						1.081.703,17	
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO						7,02901	

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	1,95%
2009	4,91%	2,55%	3 Anos	1,25%
2010	-1,11%	3,05%	5 Anos	1,43%
2011	-0,64%	2,74%	Desde o Inicio	2,32%
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%		
2020	1,95%	2,92%		

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