

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST EQUILIBRADO

31 março 2022

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 março 2022, 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					6.147,60	6.062.626,34	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					6.147,60	2.815.089,03	46,4%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					6.147,60	2.815.089,03	46,4%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					5.797,26	2.769.568,84	45,7%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	120.000,00	85,05%	EUR	85,05%	166,30	102.220,30	1,7%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	360.000,00	91,10%	EUR	91,10%	0,00	327.963,60	5,4%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	130.000,00	83,01%	EUR	83,01%	0,00	107.911,70	1,8%
DBR, 0,25%, 15/02/2029, GOVT	115.000,00	98,75%	EUR	98,75%	34,66	113.599,46	1,9%
DBR, 0,5%, 15/08/2027, GOVT	256.000,00	100,55%	EUR	100,55%	799,56	258.217,80	4,3%
DBR, 1,5%, 15/02/2023, GOVT	287.000,00	101,78%	EUR	101,78%	518,96	292.621,82	4,8%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	52.000,00	92,07%	EUR	92,07%	0,00	47.875,88	0,8%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	20.000,00	97,36%	EUR	97,36%	0,00	19.472,20	0,3%
FRTR, 0,25%, 25/11/2026, GOVT	556.000,00	98,68%	EUR	98,68%	479,84	549.135,08	9,1%
RAGB, 0%, 15/07/2023, GOVT	118.000,00	100,36%	EUR	100,36%	0,00	118.424,80	2,0%
SPGB, 0,45%, 31/10/2022, GOVT	500.000,00	100,55%	EUR	100,55%	930,82	503.660,82	8,3%
SPGB, 0,5%, 31/10/2031, GOVT	77.000,00	92,13%	EUR	92,13%	159,27	71.097,83	1,2%
SPGB, 1,9%, 31/10/2052, GOVT	45.000,00	94,87%	EUR	94,87%	100,73	42.790,43	0,7%
SPGB, 1,95%, 30/07/2030, GOVT	200.000,00	105,99%	EUR	105,99%	2.607,12	214.577,12	3,5%
1.2.3. Obrigações Diversas					350,34	45.520,19	0,8%
FRTR, 0,75%, 25/05/2053, GOVT	55.000,00	82,13%	EUR	82,13%	350,34	45.520,19	0,8%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						3.023.339,52	49,9%
3.1. Fundos Harmonizados						3.023.339,52	49,9%
AXA WORLD-EUR CR SHD-I-XCAPE (FIM)	2.924,73	100,12	EUR	100,12		292.823,47	4,8%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	4.451,00	210,34	EUR	210,34		936.223,34	15,4%
CAIXGEST OBRIGAÇÕES, FIM	66.293,67	4,40	EUR	4,40		291.864,52	4,8%
ISHARES USD HY CORP EUR-H D, FIM	28.452,00	4,47	EUR	4,47		127.095,08	2,1%
MUZIN-ENHANCEDYIELD-ST E-ACC (FIM)	1.732,43	166,08	EUR	166,08		287.722,14	4,7%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	5.571,81	166,98	EUR	166,98		930.380,17	15,3%
XTRAKERS II EUR HIGH YIELD CO, GY	9.711,00	16,19	EUR	16,19		157.230,80	2,6%
4. Imobiliário					0,00	146.586,73	2,4%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						146.586,73	2,4%
FUNDIMO (FI)	18.057,00	8,12	EUR	8,12		146.586,73	2,4%
5. Liquidez					0,00	82.663,58	1,4%
5.1. À Vista						82.663,58	1,4%
Depósitos à Ordem						82.663,58	1,4%
9. Outros Activos						-5.052,53	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores						-5.052,53	-0,1%
Juros de D.O. a Regularizar						-16,85	0,0%
Comissões						-5.035,68	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6.062.626,34

922.400,31

6,57266

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	-2,05%
2009	4,91%	2,55%	3 Anos	0,99%
2010	-1,11%	3,05%	5 Anos	0,52%
2011	-0,64%	2,74%	Desde o Inicio	2,04%
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%	2,90%		
2021	-2,05%	1,58%		

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