

CAIXA SEGURO MULTI-ESTRATÉGIA ICAE

INVEST DINÂMICO

30 Setembro 2019

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 30/09/2019, 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					3.929,82	1.993.075,45	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					3.929,82	431.743,62	21,7%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					3.929,82	431.743,62	21,7%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					3.929,82	431.743,62	21,7%
BOTS, CZ, 13/12/2019, GOVT	42.000,00	100,07%	EUR	100,07%	0,00	42.027,72	2,1%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	28.000,00	109,76%	EUR	109,76%	185,14	30.918,22	1,6%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	19.000,00	138,04%	EUR	138,04%	124,93	26.352,15	1,3%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	110.000,00	104,26%	EUR	104,26%	2.026,71	116.716,01	5,9%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	37.000,00	105,21%	EUR	105,21%	78,31	39.005,27	2,0%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	9.000,00	120,43%	EUR	120,43%	356,30	11.195,00	0,6%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	5.000,00	101,66%	EUR	101,66%	0,00	5.082,75	0,3%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	11.000,00	111,11%	EUR	111,11%	17,36	12.239,24	0,6%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	8.000,00	108,83%	EUR	108,83%	56,71	8.763,35	0,4%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	120.000,00	102,75%	EUR	102,75%	494,14	123.797,74	6,2%
SPGB, 4.3%, 31/10/2019, GOVT	15.000,00	100,37%	EUR	100,37%	590,22	15.646,17	0,8%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.539.132,34	77,2%
3.1. Fundos Harmonizados						1.539.132,34	77,2%
CAIXAGEST ACÇÕES EUROPA, FIM	21.897,86	9,58	EUR	9,58		209.687,32	10,5%
CAIXAGEST ACÇÕES PORTUGAL, FIM	9.120,00	12,29	EUR	12,29		112.097,57	5,6%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES LONGO PRAZO, FIM	7.243,00	13,09	EUR	13,09		94.804,35	4,8%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES MAIS, FIM	31.417,00	6,01	EUR	6,01		188.709,35	9,5%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	104.555,30	4,48	EUR	4,48		468.669,14	23,5%
ISHARES BARCLAYS CAPITAL EURO INFLATION BOND (FIM)	404,00	222,37	EUR	222,37		89.837,48	4,5%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	2.460,00	140,51	EUR	140,51		345.654,60	17,3%
ISHARES US TREASURY BOND ETF	1.229,00	26,29	USD	24,14		29.672,52	1,5%
5. Liquidez					0,00	37.023,72	1,9%
5.1. À Vista					0,00	37.023,72	1,9%
Depósitos à Ordem						37.023,72	1,9%
9. Outros Activos						-14.824,23	-0,7%
9.1. Outros Devedores E Credores						-14.824,23	-0,7%
Juros de D.O. a Regularizar						-5,71	0,0%
Impostos a Regularizar						2.471,40	0,1%
Comissões						-17.289,92	-0,9%

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

1.993.075,45
316.978,87
6,2877

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	-5,10%
2009	8,65%	3,73%	3 Anos	-0,42%
2010	-1,57%	4,82%	5 Anos	0,53%
2011	-4,25%	5,67%	Desde o Inicio	1,31%
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%		

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

Não se apresentam valores referentes ao ano de 2019, na medida em que o período em análise é inferior a doze meses.