

Investimento Global 5 anos Fevereiro 2023

31 outubro 2024

O produto "Investimento Global 5 anos Fevereiro 2023" teve o início de comercialização em 08/02/2023 e terminou em 08/03/2023.

1. Composição do Fundo Autónomo

Na data de referência deste Relatório, a composição discriminada dos valores que constituem o património do fundo autónomo que representa as responsabilidades desta opção de investimento é a que se apresenta de seguida, 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					426.203,21	37.229.538,67	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					421.773,42	36.262.633,42	97,4%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					4.429,79	489.429,79	1,3%
1.1.3. Obrigações Diversas					4.429,79	489.429,79	1,3%
EDP, 1.625%, 15/04/2027, CORP, CALL	500.000,00	97,00%	EUR	97,00%	4.429,79	489.429,79	1,3%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					182.730,99	15.353.810,99	41,2%
1.2.3. Obrigações Diversas					182.730,99	15.353.810,99	41,2%
AKER BP ASA, 1.125%, 12/05/2029, CORP, CALL	1.000.000,00	90,31%	EUR	90,31%	5.301,37	908.601,37	2,4%
ALD, 4%, 05/07/2027, CORP	1.000.000,00	102,22%	EUR	102,22%	12.931,51	1.035.081,51	2,8%
BNP PARIBAS, VAR, 23/01/2027, CORP, CALL	500.000,00	98,89%	EUR	98,89%	8.186,48	502.621,48	1,4%
CAPGEMINI, 1.75%, 18/04/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	96,00%	EUR	96,00%	9.397,26	969.417,26	2,6%
CARLSBERG, 4%, 05/10/2028, CORP, CALL	500.000,00	103,36%	EUR	103,36%	1.424,66	518.239,66	1,4%
CREDIT AGRICOLE, 0.125%, 09/12/2027, CORP	1.000.000,00	91,37%	EUR	91,37%	1.116,80	914.816,80	2,5%
DELL BANK INTERNATIONAL, 4.5%, 18/10/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	103,87%	EUR	103,87%	1.602,74	1.040.312,74	2,8%
ENBW INTL FIN, 3.5%, 24/07/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	102,06%	EUR	102,06%	9.493,15	1.030.043,15	2,8%
GLENCORE CAP FIN, 1.125%, 10/03/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	93,21%	EUR	93,21%	7.243,15	939.323,15	2,5%
HOLCIM FIN, 2.25%, 26/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	97,73%	EUR	97,73%	9.739,73	986.999,73	2,7%
ING GROEP, VAR, 14/11/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	103,48%	EUR	103,48%	46.885,25	1.081.725,25	2,9%
JAB HOLDINGS, 2%, 18/05/2028, CORP	1.000.000,00	96,59%	EUR	96,59%	9.095,89	974.945,89	2,6%
ORANGE, 1.375%, 20/03/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	95,29%	EUR	95,29%	8.476,03	961.406,03	2,6%
SES SA, 1.625%, 22/03/2026, CORP, CALL	500.000,00	97,62%	EUR	97,62%	4.964,04	493.044,04	1,3%
SOCIETE GENERALE, 4.125%, 21/11/2028, CORP	1.000.000,00	103,77%	EUR	103,77%	38.883,20	1.076.543,20	2,9%
VATTENFALL, 3.75%, 18/10/2026, CORP, CALL	500.000,00	101,48%	EUR	101,48%	667,81	508.062,81	1,4%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, 1.25%, 15/04/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	94,54%	EUR	94,54%	6.815,07	952.235,07	2,6%
VITERRA FIN, 1%, 24/09/2028, CORP, CALL	500.000,00	92,02%	EUR	92,02%	506,85	460.601,85	1,2%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					239.042,43	20.908.822,43	56,2%
1.3.3. Obrigações Diversas					239.042,43	20.908.822,43	56,2%
ABBVIE, 0.75%, 18/11/2027, CORP, CALL	500.000,00	94,18%	EUR	94,18%	3.565,57	474.480,57	1,3%
ALIMENTATION COUCHE-TARD, 1.875%, 06/05/2026, CORP, CALL	1.000.000,00	97,98%	EUR	97,98%	9.143,84	988.973,84	2,7%
AMERICA MOVIL, 2.125%, 10/03/2028, CORP	500.000,00	97,66%	EUR	97,66%	6.840,75	495.120,75	1,3%
ANGLO AMERICAN CAPITAL, 4.5%, 15/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	104,25%	EUR	104,25%	5.671,23	1.048.121,23	2,8%
AT&T INC, 1.6%, 19/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	95,31%	EUR	95,31%	7.232,88	960.342,88	2,6%
ATHENE GLOBAL FUNDING, 0.625%, 12/01/2028, CORP	1.000.000,00	92,05%	EUR	92,05%	5.003,41	925.453,41	2,5%
AURIZON NETWORK, 3.125%, 01/06/2026, CORP	500.000,00	100,18%	EUR	100,18%	6.506,85	507.416,85	1,4%
BANK OF AMERICA, 1.776%, 04/05/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	98,21%	EUR	98,21%	8.758,35	990.898,35	2,7%
BARCLAYS, VAR, 31/01/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	99,67%	EUR	99,67%	21.598,09	1.018.288,09	2,7%
BOOKING HOLDINGS, 4.25%, 15/05/2029, CORP, CALL	1.000.000,00	104,90%	EUR	104,90%	19.678,08	1.068.668,08	2,9%
BP CAPITAL MARKETS, 2.519%, 07/04/2028, CORP	500.000,00	98,37%	EUR	98,37%	7.142,92	498.982,92	1,3%
CELANESE, 2.125%, 01/03/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	97,16%	EUR	97,16%	14.205,48	985.835,48	2,6%
CITIGROUP, VAR, 22/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	101,61%	EUR	101,61%	3.967,32	1.020.027,32	2,7%
COCA-COLA EUROPACIFIC, 1.5%, 08/11/2027, CORP, CALL	500.000,00	96,14%	EUR	96,14%	7.336,07	488.046,07	1,3%
DIGITAL REALTY, 1.125%, 09/04/2028, CORP, CALL	500.000,00	92,72%	EUR	92,72%	3.159,25	466.769,25	1,3%
DISCOVERY COMMUNICATIONS, 1.9%, 19/03/2027, CORP, CALL	500.000,00	97,48%	EUR	97,48%	5.882,19	493.292,19	1,3%
DUKE ENERGY CORP, 3.1%, 15/06/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	99,58%	EUR	99,58%	11.720,55	1.007.530,55	2,7%
INTERCONTINENTAL HOTELS, 2.125%, 15/05/2027, CORP, CALL	500.000,00	97,79%	EUR	97,79%	4.919,52	493.889,52	1,3%
JPMORGAN CHASE & CO, 1.638%, 18/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	96,53%	EUR	96,53%	7.449,53	972.709,53	2,6%
MIZUHO FINANCIAL, 4.157%, 20/05/2028, CORP	1.000.000,00	103,24%	EUR	103,24%	18.678,03	1.051.118,03	2,8%
MMS USA, 1.25%, 13/06/2028, CORP, CALL	500.000,00	93,94%	EUR	93,94%	2.397,26	472.102,26	1,3%
NATWEST GROUP, VAR, 06/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	102,46%	EUR	102,46%	6.128,36	1.030.728,36	2,8%
NETFLIX, 3.625%, 15/05/2027, CORP	1.000.000,00	101,70%	EUR	101,70%	16.614,58	1.033.634,58	2,8%
TAKEDA PHARMACEUTICAL, 2.25%, 21/11/2026, CORP, CALL	500.000,00	98,73%	EUR	98,73%	10.604,51	504.234,51	1,4%
VERIZON COMMUNICATIONS, 1.375%, 02/11/2028, CORP	1.000.000,00	94,08%	EUR	94,08%	13.674,86	954.514,86	2,6%
ZIMMER BIOMET, 1.164%, 15/11/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	94,65%	EUR	94,65%	11.162,95	957.642,95	2,6%
5. Liquidez					0,00	525.310,58	1,4%
5.1. À Vista					0,00	525.310,58	1,4%
Depósitos à Ordem					0,00	525.310,58	1,4%
9. Outros Activos					0,00	-47.835,12	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	-47.835,12	-0,1%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	2.807,04	0,0%
Comissões						-50.642,16	-0,1%

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

37.229.538,67
351.740,61
105,84

2. Política de Investimentos

O património do Fundo Autónomo será representado no mínimo, por 95% de títulos de rendimento fixo, incluindo Obrigações e Fundos de Obrigações, correspondentes a dívida de emitentes públicos ou privados, nacionais ou internacionais, e o remanescente, se o houver, será representado por depósitos (máximo de 5%);

A carteira tem os seguintes limites:

CRITÉRIO	Mínimo	Central	Máximo
Limite por emitente *	0%	5%	10%
Minimum rating (S&P, Moody's, Fitch) **	BBB-/Baa3/BBB-	-	-

* exceto em Dívida Pública Zona Euro.

** é considerado o melhor Rating de cada título, se existir mais de uma notação.

- a) Não é permitido o investimento em risco ações, imobiliário ou alternativos.
- b) É permitido o uso de derivados para garantir a gestão eficiente da carteira.
- c) É permitido o investimento em Fundos de Obrigações, até 100% do total da carteira, nos quais o Segurador seja o único participante e a gestão seja da responsabilidade de uma entidade por si detida, desde que respeitados os limites da carteira.
- d) O limite máximo de investimento por país é:

PAÍSES	Limite máximo por País
Estados Unidos da América	35%
Alemanha, França, Reino Unido e Portugal	20%
Outros Países (*)	10%

(*) A Totalidade dos Países não OCDE não pode ultrapassar 15% do total.

O Segurador não tem uma política ou estratégia predefinidas, em matéria de intervenção e exercício do direito de voto nas sociedades emitentes. Não obstante, procurará, em cada momento, agir de acordo com aquilo que interpreta ser o melhor interesse do Tomador no que respeita a segurança, rentabilidade, diversificação e liquidez das aplicações.

Risco de potenciais conflitos de interesses: Poderá existir investimento em (i) ativos geridos pelo Grupo Fidelidade e/ou pelo Grupo Caixa Geral de Depósitos (que detém, de forma direta, uma participação de 15% no capital social e direitos de voto no Segurador); e/ou (ii) outros ativos que o Segurador, ou os seus acionistas, tenha interesses através de participações no capital e/ou presença no governo societário nas sociedades emitentes daqueles ativos. Em qualquer caso, a escolha dos ativos que compõem o Fundo Autónomo de Investimento é feita de acordo com os melhores interesses dos clientes.

3. Rendibilidade e Indicador Sumário de Risco

Não se apresentam valores relativos à rendibilidade, na medida em que o período em análise é inferior a doze meses.



O indicador sumário de risco constitui uma orientação sobre o nível de risco deste produto quando comparado com outros produtos. Mostra a probabilidade de o produto sofrer perdas financeiras, no futuro, em virtude de flutuações dos mercados ou da nossa incapacidade para pagar a sua retribuição.

Classificamos este produto na categoria 2 numa escala de 1 a 7, que corresponde a uma baixa categoria de risco. Este indicador avalia as possíveis perdas resultantes de um desempenho futuro com um nível baixo, e é muito improvável que condições de mercado desfavoráveis tenham um impacto na nossa capacidade para pagar a sua retribuição.