

Evoluir
Opção de Investimento Ativo (PPR ICAE Ações)

30 novembro 2024

EP INFRASTRUCTURE, 2.045%, 09/10/2028, CORP, CALL	100,000.00	92.42%	EUR	92.42%	291.34	92,713.34	0.1%
ERICSSON, 1.125%, 08/02/2027, CORP, CALL	100,000.00	96.50%	EUR	96.50%	909.84	97,408.84	0.1%
EURO GALAXY, FRN, 24/04/2034, MTGE, CALL	100,000.00	100.20%	EUR	100.20%	559.93	100,759.93	0.1%
EUROFINS SCIENTIFIC, 0.875%, 19/05/2031, CORP, CALL	100,000.00	83.13%	EUR	83.13%	467.47	83,594.47	0.1%
FERROVIAL SE, 4.375%, 13/09/2030, CORP	200,000.00	106.26%	EUR	106.26%	1,869.86	214,393.86	0.3%
FORVIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	200,000.00	94.84%	EUR	94.84%	2,177.08	191,847.08	0.3%
FRESENIUS, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	100,000.00	102.14%	EUR	102.14%	2,165.75	104,309.75	0.1%
GLENCORE CAP FIN, 0.75%, 01/03/2029, CORP, CALL	100,000.00	90.97%	EUR	90.97%	563.01	91,529.01	0.1%
GLENCORE CAP FIN, 1.125%, 10/03/2028, CORP, CALL	100,000.00	93.99%	EUR	93.99%	816.78	94,810.78	0.1%
GLME 3X CR, FRN, 20/01/2032, MTGE, CALL	300,000.00	99.15%	EUR	99.15%	1,839.67	299,289.67	0.4%
HARVEST CLO, 1.95%, 15/02/2030, MTGE, CALL	200,000.00	96.15%	EUR	96.15%	162.50	192,462.50	0.3%
IBERCAJA BANCO, VAR, 30/07/2028, CORP, CALL	200,000.00	103.65%	EUR	103.65%	2,948.63	210,250.63	0.3%
IBERDROLA FIN, VAR, PERP, 28/08/2172 CORP, CALL	200,000.00	100.82%	EUR	100.82%	46.54	201,676.54	0.3%
IBERDROLA INTL, VAR, PERP, 28/04/2172, CORP, CALL	200,000.00	93.44%	EUR	93.44%	2,663.01	189,539.01	0.3%
ILIAD SA, 4.25%, 15/12/2029, CORP, CALL	400,000.00	101.20%	EUR	101.20%	1,490.41	406,286.41	0.6%
INDIGO GROUP SAS, 2%, 06/07/2029, CORP, CALL	100,000.00	94.17%	EUR	94.17%	805.48	94,970.48	0.1%
ING GROEP, VAR, 12/08/2029, CORP, CALL	200,000.00	103.12%	EUR	103.12%	2,335.62	208,581.62	0.3%
ING GROEP, VAR, 23/05/2029, CORP, CALL	300,000.00	104.91%	EUR	104.91%	7,064.38	321,785.38	0.4%
INTESA SANPAOLO, VAR, 16/09/2032, CORP, CALL	300,000.00	102.41%	EUR	102.41%	2,373.29	309,603.29	0.4%
ISS GLOBAL, 2.125%, 02/12/2024, CORP, CALL	100,000.00	100.00%	EUR	100.00%	2,113.39	102,113.39	0.1%
JAB HOLDINGS, 2.5%, 25/06/2029, CORP	100,000.00	98.62%	EUR	98.62%	1,082.19	99,702.19	0.1%
JUBIL 2018-20X C1, FRN, 19/07/2031, MTGE, CALL	100,000.00	99.90%	EUR	99.90%	557.67	100,457.67	0.1%
JUBIL 2021-25X C1, FRN, 15/10/2035, MTGE, CALL	100,000.00	100.20%	EUR	100.20%	693.71	100,893.71	0.1%
KUTXABANK, VAR, 15/06/2027, CORP, CALL	300,000.00	102.73%	EUR	102.73%	6,558.90	314,748.90	0.4%
LEONARDO SPA, 2.375%, 08/01/2026, CORP, CALL	100,000.00	99.41%	EUR	99.41%	2,121.93	101,532.93	0.1%
LKQ DUTCH BOND, 4.125%, 13/03/2031, CORP, CALL	200,000.00	103.14%	EUR	103.14%	5,921.92	212,191.92	0.3%
LOGICOR FINANCING, 1.625%, 15/07/2027, CORP, CALL	100,000.00	96.01%	EUR	96.01%	614.38	96,622.38	0.1%
LOGICOR FINANCING, 4.25%, 18/07/2029, CORP, CALL	400,000.00	102.96%	EUR	102.96%	6,287.67	418,131.67	0.6%
MADISON PARK 17X, FRN, 27/07/2034, MTGE, CALL	100,000.00	100.02%	EUR	100.02%	493.19	100,513.19	0.1%
MTU AERO ENGINES, 3.875%, 18/09/2031, CORP, CALL	200,000.00	103.88%	EUR	103.88%	1,550.00	209,316.00	0.3%
MVM ENERGETIKA, 0.875%, 18/11/2027, CORP, CALL	100,000.00	91.86%	EUR	91.86%	28.77	91,887.77	0.1%
NOKIA, 3.125%, 15/05/2028, CORP, CALL	100,000.00	100.57%	EUR	100.57%	1,703.77	102,272.77	0.1%
PLUXEE NV, 3.75%, 04/09/2032, CORP, CALL	300,000.00	101.89%	EUR	101.89%	2,681.51	308,345.51	0.4%
PORSCHE AUTO HOLDING, 3.75%, 27/09/2029, CORP, CALL	300,000.00	99.95%	EUR	99.95%	1,972.60	301,816.60	0.4%
PROSUS, 1.207%, 19/01/2026, CORP, CALL	200,000.00	97.72%	EUR	97.72%	2,084.22	197,518.22	0.3%
PROSUS, 1.539%, 03/08/2028, CORP, CALL	100,000.00	92.74%	EUR	92.74%	501.76	93,245.76	0.1%
REXEL, 5.25%, 15/09/2030, CORP, CALL	300,000.00	104.97%	EUR	104.97%	3,281.25	318,200.25	0.4%
SAPPI PAPIER HOLDNG, 3.625%, 15/03/2028, CORP, CALL	100,000.00	98.87%	EUR	98.87%	755.21	99,627.21	0.1%
SCHAEFFLER AG, 4.5%, 14/08/2026, CORP, CALL	200,000.00	101.74%	EUR	101.74%	2,663.01	206,147.01	0.3%
SCHAEFFLER AG, 4.5%, 28/03/2030, CORP, CALL	300,000.00	99.15%	EUR	99.15%	9,135.62	306,588.62	0.4%
SCHAEFFLER AG, 4.75%, 14/08/2029, CORP, CALL	100,000.00	101.56%	EUR	101.56%	1,405.48	102,966.48	0.1%
SECURITAS TREASURY IRELAND, 4.375%, 06/03/2029, CORP, CALL	200,000.00	104.91%	EUR	104.91%	6,448.63	216,274.63	0.3%
SELP FIN, 0.875%, 27/05/2029, CORP, CALL	100,000.00	90.01%	EUR	90.01%	448.29	90,462.29	0.1%
SES SA, 0.875%, 04/11/2027, CORP, CALL	200,000.00	92.75%	EUR	92.75%	124.66	185,630.66	0.3%
SIEMENS ENERGY, 4.25%, 05/04/2029, CORP, CALL	100,000.00	104.10%	EUR	104.10%	2,782.88	106,881.88	0.1%
SIRIUS REAL ESTATE, 1.125%, 22/06/2026, CORP, CALL	100,000.00	96.89%	EUR	96.89%	496.23	97,388.23	0.1%
SIRIUS REAL ESTATE, 1.75%, 24/11/2028, CORP, CALL	100,000.00	92.73%	EUR	92.73%	28.77	92,755.77	0.1%
SNDPE 2X CR, FRN, 26/01/2036, MTGE, CALL	115,000.00	101.05%	EUR	101.05%	711.59	116,919.09	0.2%
SOCIETE GENERALE, 4.125%, 02/06/2027, CORP	300,000.00	103.28%	EUR	103.28%	6,136.64	315,985.64	0.4%
SYNGENTA FIN, 3.375%, 16/04/2026, CORP, CALL	100,000.00	100.20%	EUR	100.20%	2,108.22	102,311.22	0.1%
TAURON POLSKA ENERGIA SA, 2.375%, 05/07/2027, CORP	200,000.00	96.45%	EUR	96.45%	1,926.03	194,826.03	0.3%
TEVA PHARM, 4.5%, 01/03/2025, CORP, CALL	300,000.00	99.99%	EUR	99.99%	3,337.50	303,295.50	0.4%
TEVA PHARM, 7.375%, 15/09/2029, CORP, CALL	200,000.00	113.90%	EUR	113.90%	3,072.92	230,868.92	0.3%
TOTALENERGIES, VAR, PERP, 19/02/2173, CORP, CALL	200,000.00	100.60%	EUR	100.60%	248.33	201,444.33	0.3%
TOTALENERGIES, VAR, PERP, 19/11/2173, CORP, CALL	200,000.00	100.82%	EUR	100.82%	271.23	201,917.23	0.3%
UNICREDIT SPA, 2.2%, 22/07/2027, CORP, CALL	300,000.00	98.88%	EUR	98.88%	2,368.77	298,996.77	0.4%
VERALLIA SA, 1.625%, 14/05/2028, CORP, CALL	200,000.00	94.96%	EUR	94.96%	1,780.82	191,700.82	0.3%
VERALLIA SA, 3.875%, 04/11/2032, CORP, CALL	300,000.00	101.02%	EUR	101.02%	828.08	303,891.08	0.4%
VITERRA FIN, 0.375%, 24/09/2025, CORP, CALL	100,000.00	97.73%	EUR	97.73%	68.84	97,795.84	0.1%
VITERRA FIN, 1%, 24/09/2028, CORP, CALL	200,000.00	92.71%	EUR	92.71%	367.12	185,787.12	0.3%
VONOVIA SE, 0.25%, 01/09/2028, CORP, CALL	100,000.00	90.58%	EUR	90.58%	61.64	90,639.64	0.1%
VOYE 4X CR, FRN, 15/10/2034, MTGE, CALL	200,000.00	100.00%	EUR	100.00%	1,374.63	201,374.63	0.3%
WINTERSHALL, 1.332%, 25/09/2028, CORP, CALL	100,000.00	92.95%	EUR	92.95%	240.85	93,185.85	0.1%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					131,232.90	9,662,822.40	13.3%
1.3.1. Títulos De Dívida Pública					5,457.12	505,245.12	0.7%
CHILE, 3.875%, 09/07/2031, GOVT, CALL	200,000.00	102.23%	EUR	102.23%	3,057.53	207,517.53	0.3%
REP OF INDONESIA, 1.45%, 18/09/2026, GOVT	100,000.00	96.75%	EUR	96.75%	290.00	97,040.00	0.1%
REP OF INDONESIA, 1.75%, 24/04/2025, GOVT	200,000.00	99.29%	EUR	99.29%	2,109.59	200,687.59	0.3%

2. Política de Investimentos

O património do Fundo Autónomo desta opção de investimento, será representado por investimentos preferencialmente expressos em euros e no máximo de 20% em outras moedas, nos seguintes instrumentos:

Composição do Fundo	Ações e respetivos derivados, ou participações em instituições de investimento coletivo que invistam maioritariamente em ações	Obrigações e outros títulos de taxa fixa ou variável ou participações em instituições de investimento coletivo que invistam maioritariamente em obrigações	Instrumentos de Retorno Absoluto e outras classes de Ativos	Imóveis ou fundos de investimentos imobiliários e respetivos derivados	Instrumentos de Curto Prazo (tesouraria) (A)	Unidades de Participação em Fundos de Investimento Mobiliário não cotados (B)
Ativo (PPR ICAE Ações)	Máximo 50% Mínimo 20%	Máximo 70% Mínimo 20%	Máximo 25% Mínimo 0%	Máximo 50% Mínimo 10%	Máximo 10%	Máximo 50% Mínimo 0%

(A) Podendo ser ultrapassados temporariamente em períodos de grande volume de subscrições ou desinvestimentos.

(B) Não admitidos à negociação em bolsas de valores ou em mercados regulamentados de Estados membros da União Europeia ou de outros Estados.

A opção de investimento Ativo poderá investir até 20% no fundo de Investimento Imobiliário Aberto IMOFID, gerido pela Fidelidade - Sociedade Gestora de Organismos de Investimento Imobiliário, S.A., cujo capital social é detido, exclusivamente, pelo Segurador.

A opção de investimento Ativo poderá investir até 20% nos seguintes Fundos de Investimento Mobiliário, geridos pela Tenax Capital Limited, cujo capital social é detido, maioritariamente, pelo Segurador:

- Tenax ILS UCITS Fund;
- Tenax Dynamic Income Fund;
- Challenge Financial Equity Fund.

A alocação da carteira de investimentos de cada fundo autónomo por cada classe de ativos varia ao longo do tempo respeitando os limites indicados, indicando-se no quadro seguinte a alocação objetivo atual:

Classes de Ativos	Ativo (PPR ICAE Ações)		
	Inferior	Central	Máximo
Ações e outras participações de rendimento variável	20%	40%	50%
Títulos de rendimento fixo e Depósitos	20%	35%	70%
Instrumentos de retorno absoluto e outras classes de ativos	0%	0%	25%
Imóveis ou fundos de investimento imobiliários	10%	25%	50%

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
2021	8,19%	3,39%
2022	-8,13%	6,71%
2023	9,13%	4,36%

	Rend. Anualizada
1 Ano	9,13%
3 Anos	2,75%
5 Anos	n.a.
Desde o Inicio	2,73%

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