

Investimento Global 5 anos Fevereiro 2023

30 junho 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					412.320,11	36.894.657,47	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					410.628,33	36.057.303,33	97,7%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					1.691,78	477.616,78	1,3%
1.1.3. Obrigações Diversas					1.691,78	477.616,78	1,3%
EDP, 1.625%, 15/04/2027, CORP, CALL	500.000,00	95,19%	EUR	95,19%	1.691,78	477.616,78	1,3%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					223.097,98	15.586.152,98	42,2%
1.2.3. Obrigações Diversas					223.097,98	15.586.152,98	42,2%
AKER BP ASA, 1.125%, 12/05/2029, CORP, CALL	1.000.000,00	88,49%	EUR	88,49%	1.510,27	886.450,27	2,4%
ALD, 4%, 05/07/2027, CORP	1.000.000,00	100,85%	EUR	100,85%	39.453,55	1.047.963,55	2,8%
BNP PARIBAS, VAR, 23/01/2027, CORP, CALL	500.000,00	97,32%	EUR	97,32%	4.615,78	491.200,78	1,3%
CAPGEMINI, 1.75%, 18/04/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	94,09%	EUR	94,09%	3.500,00	944.380,00	2,6%
CARLSBERG, 4%, 05/10/2028, CORP, CALL	500.000,00	101,54%	EUR	101,54%	14.699,45	522.394,45	1,4%
CREDIT AGRICOLE, 0.125%, 09/12/2027, CORP	1.000.000,00	88,61%	EUR	88,61%	696,72	886.806,72	2,4%
DELL BANK INTERNATIONAL, 4.5%, 18/10/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	102,34%	EUR	102,34%	31.475,41	1.054.865,41	2,9%
ENBW INTL FIN, 3.5%, 24/07/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	100,23%	EUR	100,23%	32.704,92	1.034.984,92	2,8%
GLENCORE CAP FIN, 1.125%, 10/03/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	90,99%	EUR	90,99%	3.452,05	913.372,05	2,5%
HOLCIM FIN, 2.25%, 26/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	95,46%	EUR	95,46%	2.157,53	956.757,53	2,6%
ING GROEP, VAR, 14/11/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	102,44%	EUR	102,44%	30.502,05	1.054.922,05	2,9%
JAB HOLDINGS, 2%, 18/05/2028, CORP	1.000.000,00	94,16%	EUR	94,16%	2.356,16	943.996,16	2,6%
ORANGE, 1.375%, 20/03/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	93,04%	EUR	93,04%	3.842,47	934.262,47	2,5%
SES SA, 1.625%, 22/03/2026, CORP, CALL	500.000,00	96,38%	EUR	96,38%	2.226,03	484.141,03	1,3%
SOCIETE GENERALE, 4.125%, 21/11/2028, CORP	1.000.000,00	101,74%	EUR	101,74%	25.020,49	1.042.400,49	2,8%
VATTENFALL, 3.75%, 18/10/2026, CORP, CALL	500.000,00	100,51%	EUR	100,51%	13.114,75	515.649,75	1,4%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, 1.25%, 15/04/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	92,16%	EUR	92,16%	2.602,74	924.202,74	2,5%
VITERRA FIN, 1%, 24/09/2028, CORP, CALL	500.000,00	88,48%	EUR	88,48%	3.825,14	446.210,14	1,2%
VODAFONE INTERNAT FINANC, 3.25%, 02/03/2029, CORP, CALL	500.000,00	99,17%	EUR	99,17%	5.342,47	501.192,47	1,4%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					187.530,35	20.471.150,35	55,5%
1.3.3. Obrigações Diversas					187.530,35	20.471.150,35	55,5%
ABBVIE, 0.75%, 18/11/2027, CORP, CALL	500.000,00	91,99%	EUR	91,99%	2.305,33	462.255,33	1,3%
ALIMENTATION COUCHE-TARD, 1.875%, 06/05/2026, CORP, CALL	1.000.000,00	96,80%	EUR	96,80%	2.825,34	970.785,34	2,6%
AMERICA MOVIL, 2.125%, 10/03/2028, CORP	500.000,00	94,95%	EUR	94,95%	3.260,27	478.020,27	1,3%
ANGLO AMERICAN CAPITAL, 4.5%, 15/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	102,19%	EUR	102,19%	35.532,79	1.057.462,79	2,9%
AT&T, 1.6%, 19/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	93,14%	EUR	93,14%	1.841,10	933.261,10	2,5%
ATHENE GLOBAL FUNDING, 0.625%, 12/01/2028, CORP	1.000.000,00	89,34%	EUR	89,34%	2.903,01	896.263,01	2,4%
AURIZON NETWORK, 3.125%, 01/06/2026, CORP	500.000,00	98,84%	EUR	98,84%	1.241,44	495.451,44	1,3%
BANK OF AMERICA, 1.776%, 04/05/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	96,73%	EUR	96,73%	2.773,48	970.093,48	2,6%
BARCLAYS, VAR, 31/01/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	98,66%	EUR	98,66%	11.902,60	998.502,60	2,7%
BOOKING HOLDINGS, 4.25%, 15/05/2029, CORP, CALL	1.000.000,00	103,12%	EUR	103,12%	5.356,16	1.036.596,16	2,8%
BP CAPITAL MARKETS, 2.519%, 07/04/2028, CORP	500.000,00	96,63%	EUR	96,63%	2.898,58	486.068,58	1,3%
CELANESE, 2.125%, 01/03/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	95,24%	EUR	95,24%	7.044,52	959.414,52	2,6%
CITIGROUP, VAR, 22/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	100,28%	EUR	100,28%	28.608,36	1.031.398,36	2,8%
COCA-COLA EUROPACIFIC, 1.5%, 08/11/2027, CORP, CALL	500.000,00	93,67%	EUR	93,67%	4.815,57	473.145,57	1,3%
DIGITAL REALTY, 1.125%, 09/04/2028, CORP, CALL	500.000,00	90,17%	EUR	90,17%	1.263,70	452.128,70	1,2%
DISCOVERY COMMUNICATIONS, 1.9%, 19/03/2027, CORP, CALL	500.000,00	95,00%	EUR	95,00%	2.680,82	477.685,82	1,3%
DUKE ENERGY CORP, 3.1%, 15/06/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	97,58%	EUR	97,58%	1.273,97	977.073,97	2,6%
INTERCONTINENTAL HOTELS, 2.125%, 15/05/2027, CORP, CALL	500.000,00	95,91%	EUR	95,91%	1.339,04	480.899,04	1,3%
JPMORGAN CHASE & CO, 1.638%, 18/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	94,78%	EUR	94,78%	1.929,70	949.679,70	2,6%
MIZUHO FINANCIAL, 4.157%, 20/05/2028, CORP	1.000.000,00	102,03%	EUR	102,03%	4.669,51	1.024.949,51	2,8%
MMS USA HOLD, 1.25%, 13/06/2028, CORP, CALL	500.000,00	91,58%	EUR	91,58%	291,10	458.211,10	1,2%
NATWEST GROUP, VAR, 06/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	100,99%	EUR	100,99%	33.113,83	1.043.023,83	2,8%
NETFLIX, 3.625%, 15/05/2027, CORP	1.000.000,00	100,45%	EUR	100,45%	4.531,25	1.008.981,25	2,7%
TAKEDA PHARMACEUTICAL, 2.25%, 21/11/2026, CORP, CALL	500.000,00	97,13%	EUR	97,13%	6.823,77	492.473,77	1,3%
VERIZON COMMUNICATIONS, 1.375%, 02/11/2028, CORP	1.000.000,00	91,95%	EUR	91,95%	9.053,96	928.523,96	2,5%
ZIMMER BIOMET HOLD, 1.164%, 15/11/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	92,16%	EUR	92,16%	7.251,15	928.801,15	2,5%
5. Liquidez					0,00	407.961,82	1,1%
5.1. À Vista					0,00	407.961,82	1,1%
Depósitos à Ordem					0,00	407.961,82	1,1%
9. Outros Activos					0,00	-48.224,46	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	-48.224,46	-0,1%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	86,82	0,0%
Comissões						-48.311,28	-0,1%

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

36.894.657,47
 356.406,72
 103,52

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 de risco pressupõe que o produto é detido durante 5 anos e 1 dia.

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.