

PPR 40+ ESG

31 maio 2024

O produto “PPR 40+ ESG” iniciou a comercialização a 29/11/2021 e terminou a 23/12/2021.

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					0,00	5.066.884,85	100,0%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	5.172.214,57	102,1%
3.2. Fundos Não Harmonizados					0,00	5.172.214,57	102,1%
FIDELIDADE PPR 40+ ESG	52.967,56	97,65	EUR	97,65		5.172.214,57	102,1%
5. Liquidez						-101.426,38	-2,0%
5.1. À Vista						-101.426,38	-2,0%
Depósitos à Ordem						-101.426,38	-2,0%
9. Outros Activos					0,00	-3.903,34	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	-3.903,34	-0,1%
Comissões					0,00	-3.903,34	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA	5.066.884,85
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO	52.967,56
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO	95,66

2. Política de Investimentos

O PPR 40+ ESG é um produto financeiro em que o risco de investimento é assumido na totalidade pelo Tomador do Seguro e em que as garantias são definidas em função da valorização de um Índice de ativos compósito - Índice PPR 40+ ESG - com uma estratégia de investimento e mecanismos de controlo de risco, que permitem gerar valor. Este Índice incorpora a promoção de características ambientais ou sociais no seu processo de investimento, alinhado com os Princípios de Investimento Responsável, dedicados à criação consciente de um impacto social e ambiental positivo. É composto por uma alocação diversificada de ativos em diferentes mercados de ações, e em ativos de menor risco como títulos de dívida pública da Alemanha e França.

Este produto tem como objetivo promover características ambientais ou sociais, pelo que o Índice PPR 40+ ESG investe mais de 50% em Ações de empresas integradas em índices ESG, que estão identificadas como respeitando as práticas de boa governação.

A política de investimento definida para o produto, contempla a necessidade de cumprimento dos princípios identificados nas secções “Características ambientais ou sociais do produto financeiro” e “Estratégia de investimento”, não sendo previstos pelo produto a realização de investimentos com objetivos sustentáveis ou em ativos que não cumpram com os critérios de avaliação e seleção identificados.

Neste sentido, a previsão da alocação de ativos das componentes do índice PPR 40+ ESG é de 52% em Índices de Ações da ESG e 48% em títulos de dívida pública soberana, distribuídos da seguinte forma:

- S&P 500 ESG: 26,0%
- STOXX Europe 600 ESG-X: 26,0%
- Dívida pública República Federal da Alemanha (maturidade 10 Anos): 19,5%
- Dívida pública República Federal da Alemanha (maturidade 5 Anos): 15,0%
- Dívida pública República Federal da Alemanha (maturidade 2 Anos): 10,0%
- Dívida pública República Francesa (maturidade 10 Anos): 3,5%

O produto não contempla adicionalmente a seleção de qualquer índice Benchmark, para efeitos de avaliação do alcance das características de sustentabilidade defendidas.