

Evoluir
Opção de Investimento Dinâmico (PPR ICAE Ações)

31 agosto 2022

O produto Evoluir - Opção de Investimento Dinâmico (PPR ICAE Ações) teve o início de comercialização em 18/05/2020.

1. Composição do Fundo

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					227.898,08	174.373.711,44	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					227.898,08	77.472.544,08	44,4%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					33.049,85	3.690.225,04	2,1%
1.1.3. Obrigações Diversas					33.049,85	3.690.225,04	2,1%
BCP, 9.25%, 30/04/2167, PERP, CALL	400.000,00	89,79%	EUR	89,79%	3.083,33	362.223,33	0,2%
BRISA CONCESSAO ROD, 2.375%, 10/05/2027, CORP	700.000,00	99,65%	EUR	99,65%	5.146,92	702.696,92	0,4%
CGD, 0.375%, 21/09/2027, CORP, CALL	100.000,00	86,72%	EUR	86,72%	353,43	87.069,43	0,0%
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP	500.000,00	110,14%	EUR	110,14%	14.827,12	565.512,12	0,3%
EDP, 1.875%, 02/08/2081, CORP, CALL	600.000,00	85,27%	EUR	85,27%	893,84	512.483,84	0,3%
GALP ENERGIA, 2%, 15/01/2026, CORP, CALL	700.000,00	94,51%	EUR	94,51%	8.745,21	670.336,21	0,4%
MOTA ENGLIL, PC, 05/12/2022, CORP	250.000,00	99,07%	EUR	99,07%	0,00	247.665,83	0,1%
MOTA ENGLIL, PC, 07/03/2023, CORP	150.000,00	98,43%	EUR	98,43%	0,00	147.650,54	0,1%
MOTA ENGLIL, PC, 16/09/2022, CORP	200.000,00	97,42%	EUR	97,42%	0,00	194.836,82	0,1%
VISABEIRA, PC, 07/10/2022, CORP	100.000,00	99,80%	EUR	99,80%	0,00	99.800,00	0,1%
VISABEIRA, PC, 09/09/2022, CORP	100.000,00	99,95%	EUR	99,95%	0,00	99.950,00	0,1%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					97.303,36	16.633.704,56	9,5%
1.2.3. Obrigações Diversas					97.303,36	16.633.704,56	9,5%
ABERTIS INFRA, 2.375%, 27/09/2027, CORP, CALL	400.000,00	94,87%	EUR	94,87%	8.797,26	388.293,26	0,2%
ACCIONA FIN, 1.2%, 14/01/2025, CORP	300.000,00	93,85%	EUR	93,85%	2.258,63	283.820,63	0,2%
ARESE 14X C, FRN, 21/10/2033, MTGE, CALL	400.000,00	94,50%	EUR	94,50%	1.249,13	379.249,13	0,2%
AVOCA CLO, FRN, 15/04/2035, MTGE, CALL	300.000,00	89,75%	EUR	89,75%	783,33	270.033,33	0,2%
BABSE 2020-1X CR, FRN, 21/10/2034, MTGE, CALL	500.000,00	88,67%	EUR	88,67%	1.333,64	444.683,64	0,3%
BANCO SANTANDER, FRN, 21/11/2024, CORP	300.000,00	100,08%	EUR	100,08%	85,58	300.316,58	0,2%
BECLO 8X B2R, 2.1%, 20/01/2036, MTGE, CALL	200.000,00	92,25%	EUR	92,25%	466,67	184.966,67	0,1%
BNP PARIBAS, 2.375%, 17/02/2025, CORP	100.000,00	98,13%	EUR	98,13%	1.268,84	99.402,84	0,1%
BNP PARIBAS, VAR, 14/10/2027, CORP, CALL	200.000,00	100,06%	EUR	100,06%	4.617,12	204.729,12	0,1%
BUNGE FIN, 1.85%, 16/06/2023, CORP, CALL	600.000,00	99,67%	EUR	99,67%	2.311,23	600.325,23	0,3%
CABPK 1X C, FRN, 15/08/2034, MTGE, CALL	300.000,00	89,50%	EUR	89,50%	306,67	268.811,77	0,2%
CADOG 11X C, FRN, 15/02/2031, MTGE, CALL	380.000,00	95,35%	EUR	95,35%	366,66	362.689,06	0,2%
CADOG 8X CRR, FRN, 15/04/2032, MTGE, CALL	200.000,00	89,50%	EUR	89,50%	600,56	179.600,56	0,1%
CELLNEX FIN, 0.75%, 15/11/2026, CORP, CALL	300.000,00	86,37%	EUR	86,37%	1.781,50	260.888,50	0,1%
CGMSE 2021-2X B, FRN, 15/10/2035, MTGE, CALL	300.000,00	89,05%	EUR	89,05%	881,25	268.044,45	0,2%
CORDA 23X C, FRN, 25/04/2036, MTGE, CALL	300.000,00	92,50%	EUR	92,50%	3.307,50	280.807,50	0,2%
CREDIT AGRICOLE, 2.3%, 24/10/2026, CORP	200.000,00	95,45%	EUR	95,45%	475,00	191.369,00	0,1%
CREDIT AGRICOLE, 2.8%, 16/10/2025, CORP	500.000,00	98,49%	EUR	98,49%	1.750,00	494.175,00	0,3%
CRITERIA CAIXA, 0.875%, 28/10/2027, CORP	500.000,00	86,95%	EUR	86,95%	3.679,79	438.429,79	0,3%
CTP NV, 0.5%, 21/06/2025, CORP, CALL	300.000,00	87,94%	EUR	87,94%	291,78	264.117,78	0,2%
CTP, 0.625%, 27/11/2023, CORP, CALL	200.000,00	95,17%	EUR	95,17%	948,63	191.294,63	0,1%
DELL BANK INTERN, 0.5%, 27/10/2026, CORP, CALL	200.000,00	89,76%	EUR	89,76%	843,83	180.355,83	0,1%
DEUTSCHE BANK, 0.75%, 17/02/2027, CORP, CALL	700.000,00	87,05%	EUR	87,05%	2.804,79	612.175,79	0,4%
DOMETIC GROUP, 2%, 29/09/2028, CORP, CALL	200.000,00	76,47%	EUR	76,47%	3.682,19	156.628,19	0,1%
DRYD 2015-39X CRR, FRN, 15/04/2035, MTGE, CALL	300.000,00	92,00%	EUR	92,00%	1.026,95	277.026,95	0,2%
ELIS, CZ, 06/10/2023, CORP, CALL, CONV (PAR=31.85)	9.000,00	30,72%	EUR	30,72%	0,00	276.507,00	0,2%
EP INFRASTRUCTURE, 2.045%, 09/10/2028, CORP, CALL	250.000,00	69,42%	EUR	69,42%	4.566,23	178.123,73	0,1%
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	300.000,00	79,51%	EUR	79,51%	1.484,38	240.020,38	0,1%
GLME 3X CR, FRN, 20/01/2032, MTGE, CALL	700.000,00	90,00%	EUR	90,00%	1.878,33	631.878,33	0,4%
HARVEST CLO, 1.95%, 15/02/2030, MTGE, CALL	650.000,00	91,25%	EUR	91,25%	528,13	593.653,13	0,3%
HARVEST CLO, FRN, 15/07/2035, MTGE, CALL	500.000,00	97,50%	EUR	97,50%	1.346,25	488.846,25	0,3%
ISS GLOBAL, 2.125%, 02/12/2024, CORP, CALL	100.000,00	99,34%	EUR	99,34%	1.583,56	100.923,56	0,1%
JUBIL 2018-20X C1, 1.8%, 19/07/2031, MTGE, CALL	800.000,00	90,00%	EUR	90,00%	1.788,80	721.788,80	0,4%
JUBIL 2021-25X C1, FRN, 15/10/2035, MTGE, CALL	500.000,00	89,09%	EUR	89,09%	1.468,75	446.934,75	0,3%
LEONARDO SPA, 2.375%, 08/01/2026, CORP, CALL	600.000,00	94,74%	EUR	94,74%	9.174,66	577.584,66	0,3%
MADISON PARK 17X, FRN, 27/07/2034, MTGE, CALL	500.000,00	89,00%	EUR	89,00%	1.158,40	446.158,40	0,3%
MVM ENERGETIKA, 0.875%, 18/11/2027, CORP, CALL	300.000,00	74,97%	EUR	74,97%	2.056,85	226.954,85	0,1%
PROSUS, 1.539%, 03/08/2028, CORP, CALL	500.000,00	80,18%	EUR	80,18%	590,30	401.485,30	0,2%
SIGNIFY, 2%, 11/05/2024, CORP, CALL	100.000,00	98,59%	EUR	98,59%	622,22	99.216,22	0,1%
SIRIUS REAL ESTATE, 1.125%, 22/06/2026, CORP, CALL	100.000,00	85,51%	EUR	85,51%	215,75	85.727,75	0,0%
SIRIUS REAL ESTATE, 1.75%, 24/11/2028, CORP, CALL	100.000,00	76,13%	EUR	76,13%	1.342,47	77.467,47	0,0%
STELLANTIS NV, 2.75%, 15/05/2026, CORP, CALL	200.000,00	97,74%	EUR	97,74%	1.627,40	197.097,40	0,1%
SYNGENTA FIN, 3.375%, 16/04/2026, CORP, CALL	300.000,00	96,91%	EUR	96,91%	3.800,34	294.539,34	0,2%
TAURON POLSKA ENERGIA SA, 2.375%, 05/07/2027, CORP	350.000,00	80,47%	EUR	80,47%	1.298,12	282.943,12	0,2%
TELEFONAKTIEBOLAGET, 1.125%, 08/02/2027, CORP, CALL	500.000,00	86,08%	EUR	86,08%	3.143,83	433.543,83	0,2%
TELEFONAKTIEBOLAGET, 1.875%, 01/03/2024, CORP	200.000,00	97,69%	EUR	97,69%	1.880,14	197.268,14	0,1%
TEVA PHARM, 1.25%, 31/03/2023, CORP, CALL	300.000,00	97,59%	EUR	97,59%	1.571,92	294.350,92	0,2%
UBS GROUP, VAR, 21/03/2025, CORP, CALL	500.000,00	97,36%	EUR	97,36%	2.232,88	489.022,88	0,3%
UNICREDIT, 1.8%, 20/01/2030, CORP	200.000,00	81,45%	EUR	81,45%	2.199,45	165.099,45	0,1%
VITERRA FIN, 0.375%, 24/09/2025, CORP, CALL	400.000,00	88,26%	EUR	88,26%	1.401,37	354.453,37	0,2%
VOLKSWAGEN LEASING, 1.625%, 15/08/2025, CORP	400.000,00	96,08%	EUR	96,08%	284,93	384.608,93	0,2%
VOYE 4X CR, FRN, 15/10/2034, MTGE, CALL	200.000,00	90,00%	EUR	90,00%	574,44	180.574,44	0,1%
WINTERSHALL DEA FINANCE, 0.84%, 25/09/2025, CORP, CALL	200.000,00	91,57%	EUR	91,57%	1.564,93	184.696,93	0,1%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
1.2.4. Acções					0,00	10.499.640,90	6,0%
AEDIFICA SA, BB	945,00	95,00	EUR	95,00		89.775,00	0,1%
BASF, GY	32.612,00	42,13	EUR	42,13		1.373.943,56	0,8%
CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG, AV	1.969,00	31,65	EUR	31,65		62.318,85	0,0%
COFINIMMO, BB	823,00	101,90	EUR	101,90		83.863,70	0,0%
COUVIVO, FP	1.427,00	55,75	EUR	55,75		79.555,25	0,0%
DEUTSCHE WOHNEN AG, GY	1.536,00	22,74	EUR	22,74		34.928,64	0,0%
FABEGE AB, SS, SEK	7.521,00	94,36	SEK	8,84		66.457,05	0,0%
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS, SS, SEK	16.584,00	59,29	SEK	5,55		92.076,39	0,1%
GECINA, FP	1.480,00	89,25	EUR	89,25		132.090,00	0,1%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	69.078,00	21,60	EUR	21,60		1.492.084,80	0,9%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI, SM	9.269,00	5,92	EUR	5,92		54.826,14	0,0%
KLEPIERRE, FP	5.333,00	20,62	EUR	20,62		109.966,46	0,1%
KOJAMO OYJ, FH	5.557,00	16,77	EUR	16,77		93.190,89	0,1%
L' OREAL, FP	3.900,00	343,80	EUR	343,80		1.340.820,00	0,8%
LEG IMMOBILIEN, GY	2.208,00	75,92	EUR	75,92		167.631,36	0,1%
LVMH, FP	2.535,00	649,20	EUR	649,20		1.645.722,00	0,9%
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA, SM	9.416,00	9,17	EUR	9,17		86.297,64	0,0%
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NO, SS, SEK	27.150,00	17,28	SEK	1,62		43.933,03	0,0%
SAP, GY	5.368,00	85,12	EUR	85,12		456.924,16	0,3%
SCHNEIDER, FP	11.399,00	118,70	EUR	118,70		1.353.061,30	0,8%
TAG IMMOBILIEN AG, GY	3.596,00	9,22	EUR	9,22		33.137,14	0,0%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD, NA	3.841,00	51,69	EUR	51,69		198.541,29	0,1%
VONOVIA SE, GY	22.463,00	27,18	EUR	27,18		610.544,34	0,4%
WAREHOUSES DE PAUW SCA, BB	3.874,00	30,44	EUR	30,44		117.924,56	0,1%
WORLDLINE SA, FP	15.833,00	42,95	EUR	42,95		680.027,35	0,4%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					97.544,87	46.648.973,58	26,8%
1.3.3. Obrigações Diversas					97.544,87	10.676.900,49	6,1%
ATHENE GLOBAL FUNDING, 0.625%, 12/01/2028, CORP	700.000,00	84,37%	EUR	84,37%	2.768,84	593.365,84	0,3%
AURIZON NETWORK, 3.125%, 01/06/2026, CORP	700.000,00	98,66%	EUR	98,66%	5.453,76	696.094,76	0,4%
BALL CORP, 1.5%, 15/03/2027, CORP, CALL	200.000,00	86,83%	EUR	86,83%	497,28	174.155,28	0,1%
BALL, 0.875%, 15/03/2024, CORP, CALL	100.000,00	94,76%	EUR	94,76%	145,04	94.905,04	0,1%
BALL, 4.375%, 15/12/2023, CORP, CALL	500.000,00	100,98%	EUR	100,98%	3.626,02	508.536,02	0,3%
BANK OF AMERICA, FRN, 24/08/2025, CORP, CALL	500.000,00	99,40%	EUR	99,40%	141,26	497.156,26	0,3%
BARCLAYS, 3.375%, 02/04/2025, CORP, CALL	400.000,00	100,22%	EUR	100,22%	5.584,93	406.444,93	0,2%
BARCLAYS, FRN, 12/05/2026, CORP, CALL	100.000,00	98,70%	EUR	98,70%	69,93	98.766,93	0,1%
BECTON DICKINSON, 0.034%, 13/08/2025, CORP, CALL	100.000,00	92,67%	EUR	92,67%	1,68	92.667,68	0,1%
BLACKSTONE PRIVATE, 1.75%, 30/11/2026, CORP, CALL	100.000,00	82,67%	EUR	82,67%	1.313,70	83.983,70	0,0%
DIGITAL EURO, 1.125%, 09/04/2028, CORP, CALL	100.000,00	85,70%	EUR	85,70%	443,84	86.142,84	0,0%
DXC TECH, 1.75%, 15/01/2026, CORP, CALL	700.000,00	93,50%	EUR	93,50%	7.652,05	662.173,05	0,4%
EASYJET PLC, 1.75%, 09/02/2023, CORP, CALL	500.000,00	99,61%	EUR	99,61%	4.866,44	502.906,44	0,3%
EASYJET, 0.875%, 11/06/2025, CORP, CALL	200.000,00	92,24%	EUR	92,24%	388,36	184.874,36	0,1%
EURONET WORLDWIDE, 1.375%, 22/05/2026, CORP, CALL	500.000,00	86,79%	EUR	86,79%	1.902,40	435.867,40	0,2%
FORD MOTOR CREDIT, FRN, 01/12/2024, CORP	500.000,00	95,10%	EUR	95,10%	437,31	475.922,31	0,3%
GOLDMAN SACHS, FRN, 30/04/2024, CORP, CALL	600.000,00	100,06%	EUR	100,06%	680,90	601.040,90	0,3%
HAITONG BANK, FRN, 08/02/2025, CORP	500.000,00	99,99%	EUR	99,99%	549,13	500.509,13	0,3%
INT CONSOLIDATED AIRLINE, 0.625%, 17/11/2022, CONV	100.000,00	99,43%	EUR	99,43%	180,03	99.611,03	0,1%
INTERNATIONAL GAME TECH, 3.5%, 15/06/2026, CORP, CALL	100.000,00	94,50%	EUR	94,50%	738,89	95.238,89	0,1%
IQVIA, 2.25%, 15/03/2029, CORP, CALL	350.000,00	83,39%	EUR	83,39%	3.631,25	295.496,25	0,2%
MPT OPER, 3.325%, 24/03/2025, CORP, CALL	470.000,00	96,57%	EUR	96,57%	6.850,41	460.748,21	0,3%
NETFLIX, 3.625%, 15/05/2027, CORP	300.000,00	96,54%	EUR	96,54%	3.171,87	292.779,87	0,2%
NISSAN MOTOR, 2.652%, 17/03/2026, CORP, CALL	700.000,00	94,40%	EUR	94,40%	8.493,67	669.293,67	0,4%
NTPC, 2.75%, 01/02/2027, CORP	300.000,00	94,34%	EUR	94,34%	4.769,18	287.795,18	0,2%
PERUSAHAAN LESTARI NEGAR, 1.875%, 25/10/2025, CORP	500.000,00	99,09%	EUR	99,09%	12.208,90	507.668,90	0,3%
SNDPE 2X CR, FRN, 26/01/2036, MTGE, CALL	115.000,00	89,30%	EUR	89,30%	313,29	103.006,11	0,1%
SOUTHERN POWER CO, 1.85%, 20/06/2026, CORP	100.000,00	95,42%	EUR	95,42%	364,93	95.788,93	0,1%
STANDARD IND, 2.25%, 21/11/2026, CORP, CALL	550.000,00	83,76%	EUR	83,76%	9.594,86	470.252,86	0,3%
STELLANTIS, 3.875%, 05/01/2026, CORP, CALL	200.000,00	101,93%	EUR	101,93%	5.053,43	208.913,43	0,1%
UTAH ACQUISITION SUB, 2.25%, 22/11/2024, CORP, CALL	300.000,00	97,33%	EUR	97,33%	5.215,07	297.199,07	0,2%
WELLS FARGO, 1.338, 04/05/2025, CORP, CALL	100.000,00	97,16%	EUR	97,16%	436,22	97.595,22	0,1%
1.3.4. Acções					0,00	35.972.073,09	20,6%
3M CO, US, USD	12.906,00	124,22	USD	124,22		1.603.183,32	0,9%
ADOBE INC, US, USD	4.057,00	374,17	USD	374,17		1.518.007,69	0,9%
ALLREAL HOLDING AG, SW, CHF	402,00	153,20	CHF	156,39		62.868,93	0,0%
ALPHABET INC, US, USD	16.525,00	110,13	USD	110,13		1.819.898,25	1,0%
APPLE, US, USD	9.781,00	158,66	USD	158,66		1.551.853,46	0,9%
AROUNDTOWN SA, GY	38.550,00	2,91	EUR	2,91		112.141,95	0,1%
BHP BILLITON, AU, AUD	73.594,00	4,59	AUD	27,82		2.047.276,03	1,2%
BRITISH LAND CO PLC, LN, GBP	26.361,00	4,30	GBP	5,00		131.843,30	0,1%
CASTELLUM AB, SS, SEK	7.679,00	151,20	SEK	14,16		108.726,15	0,1%
CISCO SYSTEMS INC, US, USD	38.726,00	44,91	USD	44,91		1.739.184,66	1,0%
COCA-COLA, US, USD	38.472,00	62,22	USD	62,22		2.393.727,84	1,4%
DERWENT LONDON PLC, LN, GBP	2.871,00	24,52	GBP	28,50		81.823,58	0,0%
DIAGEO, LN, GBP	45.549,00	37,70	GBP	43,82		1.995.928,75	1,1%
ENTRA ASA, NO, NOK	4.755,00	129,40	NOK	13,02		61.908,58	0,0%
GLOBAL PAYMENTS INC, USD, US	3.444,00	125,23	USD	125,23		431.292,12	0,2%
GRAND CITY PROPERTIES, GY	3.537,00	11,85	EUR	11,85		41.913,45	0,0%
INTEL, US, USD	39.802,00	31,85	USD	31,85		1.267.693,70	0,7%
JOHNSON & JOHNSON, US, USD	13.216,00	162,32	USD	162,32		2.145.221,12	1,2%
LAND SECURITIES GROUP PLC, LN, GBP	21.273,00	6,54	GBP	7,60		161.658,48	0,1%
LONDONMETRIC PROPERTY PLC, LN, GBP	26.150,00	2,17	GBP	2,53		66.077,88	0,0%
MICROSOFT CORP, US, USD	6.854,00	262,69	USD	262,69		1.800.477,26	1,0%
NESTLE, VX, CHF	15.798,00	114,79	CHF	117,18		1.851.152,74	1,1%
NIKE, US, USD	12.746,00	105,95	USD	105,95		1.350.438,70	0,8%
PFIZER, US, USD	39.746,00	45,72	USD	45,72		1.817.187,12	1,0%
PROCTER & GAMBLE, US, USD	14.038,00	139,80	USD	139,80		1.962.512,40	1,1%
PSP SWISS PROPERTY AG, SW, CHF	1.227,00	111,10	CHF	113,41		139.158,53	0,1%
ROCHE HOLDING, VX, CHF	5.474,00	316,36	CHF	322,95		1.767.818,13	1,0%
SAMSUNG GDR, LI, USD	979,00	1.095,50	USD	1.095,50		1.072.494,50	0,6%
SEGRO PLC, LN, GBP	34.688,00	9,50	GBP	11,04		382.864,24	0,2%
SWISS PRIME SITE, SW, CHF	2.138,00	84,45	CHF	86,21		184.314,11	0,1%
TRITAX BIG BOX REIT PLC, LN, GBP	48.655,00	1,67	GBP	1,94		94.329,68	0,1%
UNITE GROUP PLC/THE, LN, GBP	9.250,00	10,55	GBP	12,26		113.427,67	0,1%
UPS, US, USD	10.139,00	194,59	USD	194,59		1.972.948,01	1,1%
VISA INC, US, USD	10.554,00	200,94	USD	200,94		2.120.720,76	1,2%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	87.347.466,57	50,1%
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	87.347.466,57	50,1%
CAIXA OBRIGAÇÕES LONGO PRAZO, FIM	3.933.465,76	11,12	EUR	11,12		43.731.485,60	25,1%
IMOFID, FII	763.862,23	46,82	EUR	46,82		35.765.786,38	20,5%
TENAX HEALTHCARE UCITS FUND, FIM	78.354,01	100,19	EUR	100,19		7.850.194,59	4,5%
5. Líquidez					0,00	10.189.891,24	5,8%
5.1. À Vista					0,00	10.189.891,24	5,8%
Depósitos a Ordem					0,00	10.189.891,24	5,8%
7. Operações Com Produtos Derivados					0,00	0,00	0,0%
7.1. Em Mercado Regulamentado					0,00	0,00	0,0%
7.1.1. Futuros					0,00	0,00	0,0%
EURO-BUND FUTURE DEZ22	-73,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
7.2. Fora De Mercado Regulamentado					0,00	-42.700,45	0,0%
7.2.1. Forwards					0,00	-42.700,45	0,0%
FORWARD EUR vs USD_KBC (7575000 USD) (EUR/USD30-03-2023)	1,00	-42.700,45	USD	-42.700,45		-42.700,45	0,0%
9. Outros Activos					0,00	-593.490,00	-0,3%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	-593.490,00	-0,3%
Transacções a Liquidar					0,00	-478.962,80	-0,3%
Impostos a Regularizar					0,00	32.272,00	0,0%
Comissões					0,00	-146.779,20	-0,1%
VALOR TOTAL DA CARTEIRA						174.373.711,44	
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO						1.666.914,71	
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO						104,61	

2. Política de Investimentos

O património de cada Fundo Autónomo 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)
Dinâmico (PPR ICAE Ações)	Máximo 50% Mínimo 20%	Máximo 70% Mínimo 20%	Máximo 25% Mínimo 0%	Máximo 50% Mínimo 10%	Máximo 10%	Máximo 50% Mínimo 25%

(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 Dinâmico investirá entre 25% e 50% nos seguintes fundos geridos pela Caixa Gestão de Ativos, S.A., sociedade gestora de fundos de investimento mobiliário, cujo capital social é detido, exclusivamente, pela Caixa Geral de Depósitos, S.A., que por sua vez detém indiretamente uma participação minoritária no Segurador:

- Caixa Ações Líderes Globais - Fundo de Investimento Mobiliário Aberto de Ações;
- Caixa Obrigações Longo Prazo - Fundo de Investimento Mobiliário Aberto Harmonizado de Obrigações de Taxa Fixa.

Estes fundos poderão ser substituídos mediante comunicação prévia aos participantes com 90 dias de antecedência.

A opção de investimento Dinâmico 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.

3. Rendibilidade e Indicador Sumário de Risco

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	
2020	3,89%	4,09%	1 Ano	8,44%
2021	8,44%	3,95%	3 Anos	n.a.
			5 Anos	n.a.
			Desde o Início	7,63%



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.¹

¹ Os PPR's estão excluídos do Regulamento PRIIP's. Não obstante, por forma a garantir a comparabilidade do risco com outros instrumentos financeiros, aplicou-se a metodologia prevista no regulamento para classificar as opções de investimento do PPR.