

Investimento Global 5 anos Fevereiro 2023

31 outubro 2023

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 Autônomo

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					444.415,62	37.305.866,01	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					439.997,93	35.888.792,93	96,2%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					4.417,69	466.662,69	1,3%
1.1.3. Obrigações Diversas					4.417,69	466.662,69	1,3%
EDP, 1.625%, 15/04/2027, CORP, CALL	500.000,00	92,45%	EUR	92,45%	4.417,69	466.662,69	1,3%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					144.917,81	13.120.722,81	35,2%
1.2.3. Obrigações Diversas					144.917,81	13.120.722,81	35,2%
AKER BP ASA, 1.125%, 12/05/2029, CORP, CALL	1.000.000,00	84,02%	EUR	84,02%	5.286,88	845.466,88	2,3%
ALD, 4%, 05/07/2027, CORP	1.000.000,00	98,33%	EUR	98,33%	12.896,17	996.146,17	2,7%
BNP PARIBAS, VAR, 23/01/2027, CORP, CALL	500.000,00	94,90%	EUR	94,90%	8.179,79	482.664,79	1,3%
CAPGEMINI, 1.75%, 18/04/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	91,81%	EUR	91,81%	9.371,58	927.501,58	2,5%
CARLSBERG, 4%, 05/10/2028, CORP, CALL	500.000,00	100,30%	EUR	100,30%	1.420,77	502.895,77	1,3%
CREDIT AGRICOLE, 0.125%, 09/12/2027, CORP	1.000.000,00	85,07%	EUR	85,07%	1.116,44	851.826,44	2,3%
DELL BANK INTERNATIONAL, 4.5%, 18/10/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	101,01%	EUR	101,01%	1.598,36	1.011.738,36	2,7%
GLENCORE CAP FIN, 1.125%, 10/03/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	86,46%	EUR	86,46%	7.223,36	871.803,36	2,3%
HOLCIM FIN, 2.25%, 26/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	92,67%	EUR	92,67%	9.713,11	936.403,11	2,5%
ING GROEP, VAR, 14/11/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	101,25%	EUR	101,25%	46.880,14	1.059.390,14	2,8%
JAB HOLDINGS, 2%, 18/05/2028, CORP	1.000.000,00	92,00%	EUR	92,00%	9.071,04	929.061,04	2,5%
ORANGE, 1.375%, 20/03/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	90,56%	EUR	90,56%	8.452,87	914.012,87	2,5%
SES SA, 1.625%, 22/03/2026, CORP, CALL	500.000,00	93,52%	EUR	93,52%	4.950,48	472.530,48	1,3%
VATTENFALL, 3.75%, 18/10/2026, CORP, CALL	500.000,00	99,65%	EUR	99,65%	665,98	498.895,98	1,3%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, 1.25%, 15/04/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	89,55%	EUR	89,55%	6.796,45	902.266,45	2,4%
VITERRA FIN, 1%, 24/09/2028, CORP, CALL	500.000,00	84,40%	EUR	84,40%	505,46	422.495,46	1,1%
VODAFONE INTERNAT FINANAC, 3.25%, 02/03/2029, CORP, CALL	500.000,00	96,97%	EUR	96,97%	10.788,93	495.623,93	1,3%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					295.080,12	22.768.070,12	61,0%
1.3.3. Obrigações Diversas					295.080,12	22.768.070,12	61,0%
ABBVIE, 0.75%, 18/11/2027, CORP, CALL	500.000,00	88,50%	EUR	88,50%	3.565,07	446.065,07	1,2%
ALIMENTATION COUCHE-TARD, 1.875%, 06/05/2026, CORP, CALL	1.000.000,00	94,30%	EUR	94,30%	9.118,85	952.068,85	2,6%
AMERICA MOVIL, 2.125%, 10/03/2028, CORP	500.000,00	92,81%	EUR	92,81%	6.822,06	470.862,06	1,3%
ANGLO AMERICAN CAPITAL, 4.5%, 15/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	100,53%	EUR	100,53%	5.655,74	1.010.925,74	2,7%
AT&T, 1.6%, 19/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	89,87%	EUR	89,87%	7.213,11	905.933,11	2,4%
ATHENE GLOBAL FUNDING, 0.625%, 12/01/2028, CORP	1.000.000,00	83,97%	EUR	83,97%	5.000,00	844.650,00	2,3%
AURIZON NETWORK, 3.125%, 01/06/2026, CORP	500.000,00	97,15%	EUR	97,15%	6.489,07	492.249,07	1,3%
BANK OF AMERICA, 1.776%, 04/05/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	93,68%	EUR	93,68%	8.734,43	945.544,43	2,5%
BARCLAYS, VAR, 31/01/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	95,97%	EUR	95,97%	21.578,22	981.318,22	2,6%
BOOKING HOLDINGS, 4.25%, 15/05/2029, CORP, CALL	1.000.000,00	101,55%	EUR	101,55%	19.624,32	1.035.084,32	2,8%
BP CAPITAL MARKETS, 2.519%, 07/04/2028, CORP	500.000,00	94,31%	EUR	94,31%	7.123,40	478.653,40	1,3%
CELANESE, 2.125%, 01/03/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	91,72%	EUR	91,72%	14.166,66	931.326,66	2,5%
CITIGROUP, VAR, 22/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	98,07%	EUR	98,07%	3.956,48	984.676,48	2,6%
COCA-COLA EUROPACIFIC, 1.5%, 08/11/2027, CORP, CALL	500.000,00	91,66%	EUR	91,66%	7.335,62	465.630,62	1,2%
DIGITAL EURO, 1.125%, 09/04/2028, CORP, CALL	500.000,00	84,78%	EUR	84,78%	3.150,61	427.060,61	1,1%
DISCOVERY COMMUNICATIONS, 1.9%, 19/03/2027, CORP, CALL	500.000,00	91,83%	EUR	91,83%	5.878,72	465.038,72	1,2%
DUKE ENERGY CORP, 3.1%, 15/06/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	94,94%	EUR	94,94%	11.688,52	961.078,52	2,6%
DXC TECH, 1.75%, 15/01/2026, CORP, CALL	500.000,00	93,59%	EUR	93,59%	6.928,08	474.863,08	1,3%
GENERAL MOTORS FIN, 4.3%, 15/02/2029, CORP, CALL	500.000,00	97,51%	EUR	97,51%	15.197,26	502.722,26	1,3%
INFORMA, 2.125%, 06/10/2025, CORP, CALL	500.000,00	96,01%	EUR	96,01%	725,75	480.785,75	1,3%
INTERCONTINENTAL HOTELS, 2.125%, 15/05/2027, CORP, CALL	500.000,00	93,42%	EUR	93,42%	4.906,08	472.026,08	1,3%
JPMORGAN CHASE & CO, 1.638%, 18/05/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	91,39%	EUR	91,39%	7.429,18	921.369,18	2,5%
MIZUHO FINANCIAL, 4.157%, 20/05/2028, CORP	1.000.000,00	98,74%	EUR	98,74%	18.626,99	1.006.066,99	2,7%
MMS USA HOLD, 1.25%, 13/06/2028, CORP, CALL	500.000,00	88,84%	EUR	88,84%	2.390,71	446.610,71	1,2%
NATWEST GROUP, VAR, 06/09/2028, CORP, CALL	1.000.000,00	97,83%	EUR	97,83%	6.111,61	984.421,61	2,6%
NETFLIX, 3.625%, 15/05/2027, CORP	1.000.000,00	98,82%	EUR	98,82%	16.614,58	1.004.794,58	2,7%
TAKEDA PHARMACEUTICAL, 2.25%, 21/11/2026, CORP, CALL	500.000,00	95,18%	EUR	95,18%	10.602,73	486.507,73	1,3%
THAMES WATER, 4%, 18/04/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	93,80%	EUR	93,80%	31.256,83	969.296,83	2,6%
VERIZON COMMUNICATIONS, 1.375%, 02/11/2028, CORP	1.000.000,00	88,36%	EUR	88,36%	13.674,66	897.314,66	2,4%
WESTLAKE, 1.625%, 17/07/2029, CORP, CALL	500.000,00	83,47%	EUR	83,47%	2.353,14	419.713,14	1,1%
ZIMMER BIOMET HOLD, 1.164%, 15/11/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	89,23%	EUR	89,23%	11.161,64	903.411,64	2,4%
5. Liquidez					0,00	1.000.909,31	2,7%
5.1. À Vista					0,00	1.000.909,31	2,7%
Depósitos à Ordem					0,00	1.000.909,31	2,7%
9. Outros Activos					0,00	-50.498,92	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	-50.498,92	-0,1%
Comissões						-50.498,92	-0,1%

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

37.305.866,01
372.188,90
100,23

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.

