

Evoluir
Opção de Investimento Ativo (PPR ICAE Ações)

31 março 2022

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					19.386,71	10.249.894,01	35,8%
1.3.3. Obrigações Diversas					19.386,71	2.639.587,71	9,2%
AURIZON NETWORK, 3.125%, 01/06/2026, CORP	100.000,00	105,94%	EUR	105,94%	2.594,18	108.531,18	0,4%
BALL CORP, 1.5%, 15/03/2027, CORP, CALL	100.000,00	96,02%	EUR	96,02%	368,78	96.385,78	0,3%
BECTON DICKINSON, 0.034%, 13/08/2025, CORP, CALL	100.000,00	96,13%	EUR	96,13%	21,42	96.149,42	0,3%
BLACKSTONE PRIVATE, 1.75%, 30/11/2026, CORP, CALL	100.000,00	93,54%	EUR	93,54%	580,14	94.121,14	0,3%
EASYJET, 0.875%, 11/06/2025, CORP, CALL	100.000,00	97,01%	EUR	97,01%	702,40	97.712,40	0,3%
GOLDMAN SACHS GROUP INC, 3.375%, 27/03/2025, CORP	200.000,00	106,01%	EUR	106,01%	73,97	212.095,97	0,7%
HAITONG BANK, FRN, 08/02/2025, CORP	200.000,00	99,85%	EUR	99,85%	255,57	199.953,57	0,7%
HEATHROW FUNDING, 1.125%, 08/10/2030, CORP, CALL	100.000,00	90,69%	EUR	90,69%	1.100,34	91.789,34	0,3%
INT CONSOLIDATED AIRLINE, 0.625%, 17/11/2022, CONV	100.000,00	98,22%	EUR	98,22%	231,35	98.452,35	0,3%
INTERMEDIATE CAP, 1.625%, 17/02/2027, CORP, CALL	100.000,00	95,09%	EUR	95,09%	186,99	95.277,99	0,3%
INTERNATIONAL GAME TECH, 3.5%, 15/06/2026, CORP, CALL	200.000,00	100,66%	EUR	100,66%	2.061,11	203.385,11	0,7%
IQVIA, 2.875%, 15/06/2028, CORP, CALL	200.000,00	96,39%	EUR	96,39%	1.677,08	194.457,08	0,7%
NETFLIX, 3.625%, 15/05/2027, CORP	200.000,00	106,96%	EUR	106,96%	2.718,75	216.632,75	0,8%
NTPC, 2.75%, 01/02/2027, CORP	200.000,00	99,11%	EUR	99,11%	873,97	199.089,97	0,7%
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR, 1.875%, 25/10/2025, CORP	200.000,00	102,76%	EUR	102,76%	2.473,29	207.983,29	0,7%
SNDPE 2X CR, FRN, 26/01/2036, MTGE, CALL	115.000,00	99,60%	EUR	99,60%	330,31	114.870,31	0,4%
SOUTHERN POWER CO, 1.85%, 20/06/2026, CORP	100.000,00	100,44%	EUR	100,44%	1.439,45	101.880,45	0,4%
STELLANTIS, 3.875%, 05/01/2026, CORP, CALL	100.000,00	107,60%	EUR	107,60%	902,40	108.499,40	0,4%
UTAH ACQUISITION SUB, 2.25%, 22/11/2024, CORP, CALL	100.000,00	101,53%	EUR	101,53%	795,21	102.320,21	0,4%
1.3.4. Acções					0,00	7.610.306,30	26,6%
3M CO, US, USD	2.511,00	150,26	USD	135,36		339.881,87	1,2%
ADOBE INC, US, USD	789,00	463,28	USD	417,33		329.274,77	1,2%
ALLREAL HOLDING AG, SW, CHF	68,00	197,40	CHF	192,27		13.074,12	0,0%
ALPHABET INC, US, USD	162,00	2.832,85	USD	2.551,89		413.405,73	1,4%
APPLE, US, USD	2.903,00	176,71	USD	159,18		462.110,74	1,6%
AROUNDTOWN SA, GY	5.539,00	5,25	EUR	5,25		29.057,59	0,1%
BHP BILLITON, AU, AUD	12.943,00	51,71	AUD	34,87		451.333,56	1,6%
BRITISH LAND CO PLC, LN, GBP	4.166,00	5,34	GBP	6,31		26.277,88	0,1%
CASTELLUM AB, SS, SEK	1.214,00	234,10	SEK	22,65		27.493,22	0,1%
CISCO SYSTEMS INC, US, USD	7.499,00	56,73	USD	51,10		383.225,18	1,3%
COCA-COLA, US, USD	7.028,00	62,31	USD	56,13		394.482,19	1,4%
DERWENT LONDON PLC, LN, GBP	455,00	32,20	GBP	38,06		17.318,99	0,1%
DIAGEO, LN, GBP	8.797,00	38,83	GBP	45,91		403.843,60	1,4%
ENTRA ASA, NO, NOK	755,00	176,70	NOK	18,20		13.737,87	0,0%
GRAND CITY PROPERTIES, GY	517,00	18,15	EUR	18,15		9.383,55	0,0%
INTEL, US, USD	7.333,00	50,62	USD	45,60		334.381,10	1,2%
JOHNSON & JOHNSON, US, USD	2.449,00	179,82	USD	161,99		396.702,26	1,4%
LAND SECURITIES GROUP PLC, LN, GBP	3.239,00	7,92	GBP	9,36		30.309,03	0,1%
LONDONMETRIC PROPERTY PLC, LN, GBP	4.015,00	2,76	GBP	3,26		13.108,85	0,0%
MICROSOFT CORP, US, USD	1.470,00	312,96	USD	281,92		414.423,21	1,4%
NESTLE, VX, CHF	3.069,00	120,62	CHF	117,48		360.555,94	1,3%
NIKE, US, USD	2.476,00	137,00	USD	123,41		305.568,87	1,1%
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B, US, USD	1.859,00	38,00	USD	34,23		63.635,71	0,2%
PFIZER, US, USD	7.718,00	52,33	USD	47,14		363.825,73	1,3%
PROCTER & GAMBLE, US, USD	2.946,00	153,20	USD	138,01		406.564,45	1,4%
PSP SWISS PROPERTY AG, SW, CHF	192,00	121,90	CHF	118,73		22.796,14	0,1%
ROCHE HOLDING, VX, CHF	1.064,00	368,80	CHF	359,21		382.198,50	1,3%
SAMSUNG GDR, LI, USD	190,00	1.423,50	USD	1.282,32		243.640,21	0,9%
SEGRO PLC, LN, GBP	5.380,00	13,50	GBP	15,95		85.824,34	0,3%
SWISS PRIME SITE, SW, CHF	340,00	91,25	CHF	88,88		30.218,17	0,1%
TRITAX BIG BOX REIT PLC, LN, GBP	7.693,00	2,43	GBP	2,87		22.098,22	0,1%
UNITE GROUP PLC/THE, LN, GBP	1.438,00	11,59	GBP	13,70		19.701,42	0,1%
UPS, US, USD	1.972,00	218,13	USD	196,50		387.489,74	1,4%
VISA INC, US, USD	2.048,00	224,06	USD	201,84		413.363,55	1,4%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	5.720.255,55	20,0%
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	5.720.255,55	20,0%
IMOFID, FII	126.452,77	45,24	EUR	45,24		5.720.255,55	20,0%
5. Liquidez					0,00	2.895.920,80	10,1%
5.1. À Vista					0,00	2.895.920,80	10,1%
Depósitos à Ordem					0,00	2.895.920,80	10,1%
9. Outros Activos					0,00	-321.985,19	-1,1%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	-321.985,19	-1,1%
Transacções a Liquidar					0,00	-292.276,59	-1,0%
Impostos a Regularizar					0,00	437,80	0,0%
Comissões					0,00	-30.146,40	-0,1%

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

28.600.487,23
271.192,16
105,46

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	Rend. Anualizada	
2021	8,19%	3,39%	1 Ano	8,19%
			3 Anos	n.a.
			5 Anos	n.a.
			Desde o Inicio	8,19%

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