

Alves Ribeiro PPR - Fundo de Investimento Mobiliário Aberto de Poupança Reforma

Morningstar® Category Index

Cat 75%Barclays Eu Agg&25%FTSE AW
Dv Eur

(Usado ao longo do relatório)

Benchmark do fundo

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

★★★★★

Categoria Morningstar™

Mistos Defensivos EUR

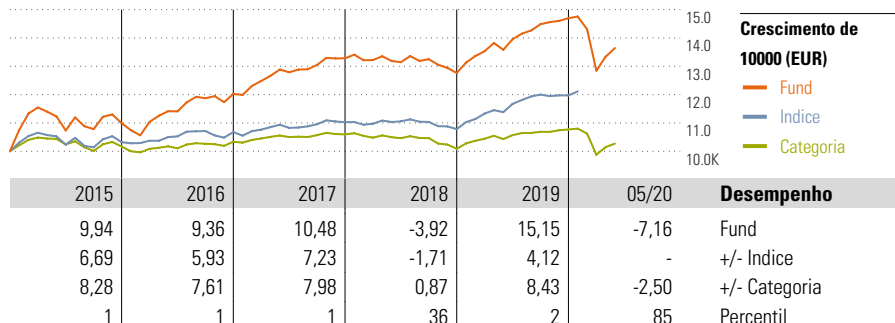
Política de investimento

Na prossecução do seu objectivo, enquanto Fundo Poupança-Reforma, o seu património será composto maioritariamente por obrigações com maturidades superiores a 1 ano. Em menor percentagem, o OIA investirá em acções e outros activos de maior risco de forma a aproveitar oportunidades de mercado que revelem maior potencial de valorização futura; O OIA será composto em mais de 50% por obrigações de estados membros da União Europeia emitida a mais de um ano; As aplicações em acções ou OIAs de acções nacionais ou...

Medidas de Risco

Alfa	-0,85	Rácio de Sharpe	0,33
Beta	1,48	Desv.Padrão(3a.)	8,02
R²	91,46		
Rácio de informação	0,03		
Tracking Error	3,42		

Cálculos usando o Cat 75%Barclays Eu Agg&25%FTSE AW Dv Eur (onde aplicável)



Rend. Anualiz. %

(8 jun 2020)

	Rentabilid ade	+/-Ind	+/-Cat
3 meses	0,29	-1,81	1,03
6 meses	-2,59	-6,41	-0,23
1 ano	3,53	-7,07	3,38
3 anos anualiz.	3,32	-1,32	3,14
5 anos anualiz.	5,46	2,10	4,74

Risco

Menor risco	Maior risco
Remunerações tipicamente mais baixas	Remunerações tipicamente mais altas

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Fonte: Morningstar

Carteira 29 fev 2020

Aloc. de ativos	% longo	% curto	% líquido
Acções	25,82	0,00	25,82
Obrigações	57,34	0,00	57,34
Liquidez	9,71	0,02	9,69
Outro	7,15	0,00	7,15

Morningstar Style Box™

Estilo de acções

		Capitalização		
		Grd.	Méd.	Pequena
Estilo	Valor			
	Misto			
	Crescimento			

Estilo de obrigações

			Qualidade creditícia		
			Alta	Média	Baixo
Sensibilidade às taxas de juro	Baixa				
	Média				
	Alta				

América Europa Alargada Ásia alargada



As 10 maiores posições	Sector	% Cart.
iShares STOXX Europe 50 ETF...	—	7,00
Invesco EURO STOXX 50 ETF	—	6,99
Italy (Republic Of)...	—	4,00
EDP-Energias de Portugal SA...	—	2,46
iShares EURO STOXX Banks 30-15...	—	2,32
United States Treasury Notes...	—	2,16
EDP-Energias de Portugal SA...	—	2,00
Germany (Federal Republic Of) 0%	—	1,86
Banca Ifis 2%2023-04-24	—	1,80
Greece (Republic Of)...	—	1,64
Nº Total de Acções		14
Nº Total de Obrigações		67
% de ativos nas 10 maiores posições		32,23

Distribuição por sectores

	% Acções
Cyclical	37,62
Materiais Básicos	8,08
Consumo Cíclico	6,92
Serviços Financeiros	22,11
Imóvel	0,50
Sensitive	32,73
Serviços de Comunicação	13,00
Energia	5,52
Produtos Industrializados	7,86
Tecnologia	6,35
Defensive	29,66
Consumo Defensivo	8,45
Saúde	10,12
Serviços públicos	11,09

Desagregação por regiões

	% Acções
América	4,69
Estados Unidos	3,97
Canadá	0,20
América Latina	0,52
Europa	91,33
Reino Unido	14,89
Zona Euro	69,05
Europa (ex Zona Euro)	6,80
Europa - Emergente	0,22
Middle East / Africa	0,36
Ásia	3,99
Japão	0,28
Australasia	0,33
Ásia - desenvolvida	1,19
Ásia - Emergente	2,19

Informação

Nome do grupo	Invest Gestão de Activos...	Domicílio	Portugal	Montante mínimo inicial	EUR 50
Telefone	+351 213 821 748	Moeda do fundo	EUR	Montante mínimo adicional	EUR 1
Site Internet	www.bancoinvest.pt	UCITS	Não		
Data do lançamento	15 nov 2001	Inc/Acc	Acc		
Nome do gestor	Paulo Monteiro	Isin	PTARMCLM0004		
Data de recrutamento	15 nov 2001				

© 2020 Morningstar. Todos os direitos reservados. A informação aqui contida (1) encontra-se protegida a favor de Morningstar (2) não pode ser adaptada ou distribuída (3) não constitui uma recomendação pela Morningstar Network S.L. para vender ou comprar (4) é oferecida exclusivamente para fins informativos (5) não é garantido o seu carácter exacto, completo nem tempestivo. Esta informação proveniente da Morningstar Network S.L. é facultada pelo utilizador por próprio risco do utilizador. O utilizador concorda que a Morningstar Network S.L. não são responsáveis por quaisquer danos ou perdas resultantes de qualquer uso da informação e que a informação não pode constituir fundamento de qualquer decisão do utilizador sem adequada verificação do teor da mesma. Morningstar Network S.L. informa o utilizador do seguinte: (i) nenhuma decisão de investimento deve ser feita com base em qualquer informação facultada a não ser sob aconselhamento de um consultor financeiro profissional (ii) rendibilidades passadas não significam rendibilidades futuras.

VL (8 jun 2020)	EUR 16,92
Ativos Liq.(Milh)	EUR 85,53