

A thick red line forming an L-shape, starting vertically on the left and then turning horizontally to the right.

Anexo I – RTS SFDR

22 de julho 2025

Declaração relativa aos principais impactos negativos das decisões de investimento sobre os fatores de sustentabilidade da Fidelidade Sociedade Gestora de Organismos de Investimento Coletivo, S.A..

RESUMO

FIDELIDADE – Sociedade Gestora de Organismos de Investimento Coletivo, S.A. (doravante designada por “Sociedade Gestora” ou “Fidelidade SGOIC”), LEI 213800FF11RR1DRA6666, considera os Principais Impactos Negativos (doravante designados por “PAI” – sigla em inglês para “*Principal Adverse Impacts*”) das suas decisões de investimento nos fatores de sustentabilidade. Nesta medida, o presente documento visa conferir publicidade à declaração consolidada dos Principais Impactos Negativos nos fatores de sustentabilidade da Fidelidade SGOIC.

Esta declaração sobre os PAI nos fatores de sustentabilidade abrange o período de referência de 1 de janeiro a 31 de dezembro de 2024.

De acordo com os requisitos normativos relativos ao SFDR, a Fidelidade SGOIC, enquanto sociedade gestora de organismos de investimento alternativo imobiliários, tem os seguintes Principais Impactos Negativos (PAI) obrigatórios:

Eficiência Energética – Exposição a ativos imobiliários energeticamente ineficientes, avaliado através da quota-parte dos investimentos em ativos imobiliários ineficientes do ponto de vista energético.

O PAI de Eficiência Energética apresenta um valor de 33,3% com referência a 31 de dezembro de 2024.

Combustíveis Fósseis – Exposição a combustíveis fósseis através de ativos imobiliários, avaliado através da quota-parte dos investimentos em ativos imobiliários envolvidos na extração, armazenamento, transporte ou produção de combustíveis fósseis.

A exposição a combustíveis fósseis, embora tratando-se de um PAI aplicável a investimentos em ativos imobiliários, tem no portfolio de ativos imobiliários dos veículos de investimento geridos pela Fidelidade SGOIC um valor de zero, uma vez que nenhum dos ativos alvo de investimento está envolvido na extração, armazenamento, transporte ou produção de combustíveis fósseis.

Para além dos PAI obrigatórios, a Fidelidade SGOIC reporta ainda o PAI adicional referente a:

Consumo de energia - Intensidade do consumo de energia, avaliado através do consumo de energia em GWh de ativos imobiliários detidos por metro quadrado.

Considerando que ainda não existe monitorização do consumo de energia de todos os ativos (processo em curso), para a análise deste indicador considerou-se o indicador de intensidade energética conforme indicado no certificado energético de cada edifício, o qual indica a quantidade de energia primária consumida por m², por ano.

De acordo com esta estimativa, o PAI de Consumo de Energia tem um valor de $2,3e^{-4}$ GWh/m² para o ano de 2024.

Statement on principal adverse impacts of investment decisions on sustainability factors of Fidelidade Sociedade Gestora de Organismos de Investimento Coletivo, S.A..

ABSTRACT

FIDELIDADE SOCIEDADE GESTORA DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO, S.A. (hereinafter referred to as "Management Company" or "Fidelidade SGOIC"), LEI 213800FF11RR1DRA6666 considers the principal adverse impacts of its investment decisions on sustainability factors. The present statement is the consolidated statement on Principal Adverse Impacts (PAI) on sustainability factors of Fidelidade SGOIC.

This statement on principal adverse impacts on sustainability factors covers the reference period from January 1 to December 31, 2024.

According with SFDR regulatory requirements, Fidelidade SGOIC, as a management company of real estate assets, has the following mandatory Principal Adverse Impacts (PAI):

Energy Efficiency – Exposure to energy-inefficient real estate assets, evaluated through the share of investments in energy-inefficient real estate assets.

The Energy Efficiency PAI shows a value of 33.3% as of December 31st, 2024.

Fossil fuels – Exposure to fossil fuels through real estate assets, evaluated through the share of investments in real estate assets involved in the extraction, storage, transport or manufacture of fossil fuels.

Fossil fuels exposure, despite being a PAI applicable to investments in real estate assets, with regards to Fidelidade SGOIC's portfolio it has a value of zero, as none of the assets invested in is involved in the extraction, storage, transportation, or manufacturing of fossil fuels.

In addition to the mandatory PAI, Fidelidade SGOIC also reports the additional PAI related to:

Energy consumption – Energy consumption intensity, measured by energy consumption in GWh of owned real estate assets owned per square meter.

Considering that there is still no energy consumption monitoring of all assets (ongoing process), for the analysis of this indicator it was considered the energy intensity indicator as indicated in the energy certificate of each building, which indicates the amount of primary energy consumed per m², per year.

According to this estimation, the Energy Consumption IAP has a value of $2.3e^{-4}$ GWh/m² for the year 2024.

DESCRIÇÃO DOS PRINCIPAIS IMPACTOS NEGATIVOS SOBRE OS FATORES DE SUSTENTABILIDADE

Indicador de sustentabilidade negativo	Métrica	Impacto (2024)	Impacto (2023)	Impacto (2022)	Impacto (2021)	Justificação	Ações tomadas em 2024 e planeadas para 2025
Combustíveis Fósseis - Exposição a combustíveis fósseis através de ativos imobiliários	Quota-parte dos investimentos em ativos imobiliários envolvidos na extração, armazenamento, transporte ou produção de combustíveis fósseis	0	0	0	N/A	Nenhum dos ativos imobiliários alvo de investimento está envolvido na extração, armazenamento, transporte ou produção de combustíveis fósseis	N.A.
Eficiência Energética - Exposição a ativos imobiliários ineficientes do ponto de vista energético.	Quota-parte dos investimentos em ativos imobiliários ineficientes do ponto de vista energético	33,3%	35,8%	37,4%	N/A	Todos os ativos imobiliários que integram o portfólio sob gestão da Fidelidade SGOIC são anteriores a 2020 e a maioria apresenta uma classe energética superior a C.	- Avaliação da conformidade dos requisitos da taxonomia UE em todo o portfólio (Estratégia ESG Sustainability Initiative SI09). - Execução de ESG Due Diligences em toda o portfolio, abrangendo todas as categorias, incluindo a análise sobre emissões elevadas de carbono e outras práticas que contribuem para as alterações climáticas (SI11) - Desenvolvimento de um programa de gestão de energia, começando com auditorias energéticas/NZC. Posteriormente, desenvolver um plano de ação de eficiência energética (SI22)
Consumo de energia - Intensidade de consumo de energia	Consumo de energia em GWh de ativos imobiliários detidos, por metro quadrado	2,3e ⁻⁴	2,2e ⁻⁴	2,2e ⁻⁴	N/A	Considerou-se o indicador de intensidade energética indicado no certificado energético de cada edifício, que indica a quantidade de energia primária consumida por m ² , por ano	- Rever os atuais contratos de fornecimento de eletricidade, sob a propriedade da IMOFID e mudar para contratos de energia verde (SI23) - Envolver os inquilinos a fim de partilhar informações sobre os seus contratos de eletricidade e aconselhar sobre a importância de obter energia verde. Avaliar a possibilidade de dar qualquer compensação aos inquilinos que mudem para a energia verde (SI24) - Desenvolver estudos no local para avaliar a viabilidade da instalação de sistemas de energia renovável (SI25)

Nota: Foram detetadas incorreções na metodologia de cálculo original dos PAI e, consequentemente, após correção, os valores relativos ao ano de 2022 apresentam diferenças relativamente aos valores inicialmente publicados

DESCRIÇÃO DAS POLÍTICAS DE IDENTIFICAÇÃO DE PRIORIDADES NO QUE SE REFERE AOS PRINCIPAIS IMPACTOS NEGATIVOS SOBRE OS FATORES DE SUSTENTABILIDADE

Esta declaração sobre os PAI nos fatores de sustentabilidade abrange o período de referência de 1 de janeiro a 31 de dezembro de 2024.

A matriz de atuação adotada na Fidelidade SGOIC, relativa à identificação de prioridades no que se refere aos PAI sobre os fatores de sustentabilidade, tem os seus responsáveis devidamente identificados assim como as metodologias de seleção de indicadores, probabilidade de ocorrência, gravidade e caráter potencialmente irremediável, conforme detalhado de seguida.

A Sociedade Gestora visa promover as características ambientais como parte da sua política de gestão de riscos. Os objetivos ambientais promovidos pela Fidelidade SGOIC estão detalhados na sua Estratégia ESG.

Os objetivos ESG a atingir a partir da aquisição dos edifícios são definidos e são objeto de um plano de ação. Nos termos do artigo 8.º do Regulamento SFDR, a Sociedade Gestora determinou os critérios conducentes à decisão de investimento dos veículos por si geridos através de uma *Due Diligence* ESG.

Os principais impactos negativos nos fatores de sustentabilidade são enumerados a seguir, em conformidade com o artigo 4.º do Regulamento SFDR:

- Exposição a combustíveis fósseis
- Exposição a ativos imobiliários com utilização intensiva de energia
- Emissão de Gases de Efeito de Estufa
- Intensidade do consumo de energia
- Produção de resíduos a partir de atividades operacionais
- Artificialização de solos

Em conformidade com o artigo 10.º do Regulamento SFDR e para cada produto financeiro referido nos artigos 8.º e 9.º do referido normativo, a Sociedade Gestora publica no seu *website*:

- uma descrição completa dos objetivos ambientais prosseguidos;
- informações sobre os métodos utilizados para avaliar, medir e monitorizar a realização destes objetivos ambientais.

A Fidelidade SGOIC descreve no seu relatório anual em que medida os objetivos ambientais foram atingidos.

As tarefas de identificação, avaliação e acompanhamento de risco são, numa primeira análise, desempenhadas por cada colaborador da Fidelidade SGOIC dentro da respetiva área funcional que ocupam, e reportadas ao responsável pela Área de Gestão de Risco.

Dentro da Fidelidade SGOIC, e tendo em conta a sua atual dimensão e a complexidade dos ativos propriedade dos OICs por si geridos, haverá um único responsável pela análise e gestão de risco para todas as operações realizadas interna e externamente.

A monitorização e o acompanhamento dos vários riscos existentes na atividade da Fidelidade SGOIC e dos OICs por si geridos são feitos através de uma atuação concertada entre a Comissão Executiva e o responsável pela Área de Gestão de Risco.

Apesar de na presente declaração de PAI, referente a 2024, apenas se estarem a reportar os indicadores referentes à exposição a combustíveis fósseis, exposição a ativos imobiliários com utilização intensiva de energia e intensidade de consumo de energia, pretende-se que em declarações futuras seja possível apresentar informação sobre os restantes PAI.

Atualmente, as fontes de informação utilizadas para a avaliação dos PAI indicados são os certificados energéticos dos ativos imobiliários que fazem parte do portfolio dos OIC geridos pela Fidelidade SGOIC.

POLÍTICAS DE ENVOLVIMENTO

A diligência devida que contorna a atuação da Fidelidade SGOIC inclui, relativamente aos PAI, os seguintes:

- Divulgação dos respetivos PAI, já identificados na política de gestão de risco (em cima indicado), através do *website* da Fidelidade SGOIC. Para 2024 estão ainda apenas avaliados os seguintes PAI:

Eficiência Energética -. Exposição a ativos imobiliários energeticamente ineficientes, avaliado através da participação de investimentos em ativos imobiliários ineficientes em energia.

Combustíveis Fósseis - Exposição a combustíveis fósseis por meio de ativos imobiliários, avaliado através da participação dos investimentos em ativos imobiliários envolvidos na extração, armazenamento,

Consumo de energia - Intensidade do consumo de energia, avaliado através do consumo de energia em GWh de ativos imobiliários detidos por metro quadrado.

- Divulgação de metas ou ações a desenvolver para reduzir estes PAI, incluindo a indicação dos respetivos responsáveis, timings e KPI para a sua realização, em conformidade com a Estratégia e *Roadmap* ESG em vigor, tal como identificado na tabela de descrição dos principais impactos negativos sobre os fatores de sustentabilidade.
- Revisão anual de PAI e das respetivas metas ou ações para redução desses PAI, com o seu ajuste ou alteração caso os resultados produzidos não contribuam para a redução dos respetivos PAI.

REFERÊNCIAS ÀS NORMAS INTERNACIONAIS

A Fidelidade SGOIC cumpre os códigos de conduta empresarial responsável e as normas internacionalmente reconhecidas em matéria de diligência devida e de apresentação de relatórios e, se for o caso, o grau do seu alinhamento com os objetivos do Acordo de Paris.

De acordo com a Estratégia ESG da Fidelidade SGOIC, estão definidos os seguintes objetivos que pretendem minimizar os respetivos PAI e de igual forma responder aos objetivos do Acordo de Paris, nomeadamente:

- Até 2035 todos os edifícios serão *Net-Zero Carbon*, antecipando os objetivos do acordo de Paris;
- Até 2035 mais de 90% da energia consumida em todos os ativos imobiliários será proveniente de fontes renováveis
- Até 2035 mais de 90% dos ativos imobiliários terá uma certificação internacional de construção sustentável (BREEAM ou LEED)
- Até 2035 mais de 90% dos ativos imobiliários considerados elegíveis ou seja, que após avaliação técnica demonstrem ter capacidade para tal, deverão ter produção de energias renováveis *on-site*

Para o cumprimento destes objetivos a Fidelidade SGOIC mantém atualizado um *Roadmap* ESG, onde as respetivas medidas e timings de implementação são identificadas.

COMPARAÇÃO EM TERMOS HISTÓRICOS

A Fidelidade SGOIC apresenta nesta declaração os seus PAI para o ano 2024, considerando a informação constante nos Certificados energéticos dos ativos imobiliários que integram os portfólios dos OIC por si geridos.

As diferenças entre os valores registados em 2023 e em 2022 (incorporando já a correção à metodologia de cálculo) ficam a dever-se à alienação de 2 ativos ineficientes pertencentes ao portfólio imobiliário de um dos veículos de investimento sob gestão.

A caducidade e consequente renovação de alguns certificados energéticos, realizada durante os anos de 2023 e 2024, alterou os dados de base utilizados na análise e quantificação dos PAI, explicando as diferenças registadas nos referidos anos e relativamente aos valores registados em 2022.

Adicionalmente, durante o ano de 2024 ocorreu a ocupação de um espaço de retalho e, consequentemente, passou a considerar-se o certificado energético definitivo deste espaço em vez do certificado energético provisório inicialmente considerado nas análises realizadas em anos anteriores.