

CAIXA PPR INVESTIMENTO

31 dezembro 2020

O produto Caixa PPR/E INVESTIMENTO teve um período de comercialização com início em 30/11/1998. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31/12/2020, sendo que as valorizações utilizadas correspondem às cotações disponíveis no último dia útil do exercício.

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
Parte I - Valores Patrimoniais					25.686,78	6.660.544,91	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					25.686,78	4.125.706,29	61,9%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					0,00	0,00	0,0%
1.1.4. Acções						0,00	0,0%
BANIF, PL	126,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
BES, PL	40.936,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					25.686,78	4.116.370,52	61,8%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					25.686,78	2.771.090,82	41,6%
BKO, 0%, 10/09/2021, GOVT	740.000,00	100,47%	EUR	100,47%	0,00	743.500,20	11,2%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	70.000,00	110,21%	EUR	110,21%	119,23	77.264,83	1,2%
BTPS, 3.45%, 01/03/2048, GOVT	85.000,00	147,42%	EUR	147,42%	980,18	126.282,93	1,9%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	113.000,00	144,60%	EUR	144,60%	1.894,68	165.290,42	2,5%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	3.000,00	107,54%	EUR	107,54%	6,58	3.232,90	0,0%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	6.000,00	108,22%	EUR	108,22%	11,41	6.504,79	0,1%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	740.000,00	100,00%	EUR	100,00%	18.348,36	758.363,16	11,4%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	101.000,00	104,09%	EUR	104,09%	0,00	105.130,90	1,6%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	117.000,00	105,10%	EUR	105,10%	29,65	122.997,82	1,8%
FRTR, 2%, 25/05/2048, GOVT	50.000,00	145,61%	EUR	145,61%	605,48	73.409,98	1,1%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	156.000,00	114,16%	EUR	114,16%	1.235,18	179.318,54	2,7%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	64.000,00	108,18%	EUR	108,18%	96,00	69.333,12	1,0%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	285.000,00	118,63%	EUR	118,63%	2.360,03	340.461,23	5,1%
1.2.4. Acções						1.345.279,70	20,2%
ADIDAS, GY	65,00	297,90	EUR	297,90		19.363,50	0,3%
AIR LIQUIDE, FP	196,00	134,25	EUR	134,25		26.313,00	0,4%
AIRBUS GROUP, FP	304,00	89,78	EUR	89,78		27.293,12	0,4%
AKZO NOBEL, NA	180,00	87,86	EUR	87,86		15.814,80	0,2%
ALLIANZ, GY	95,00	200,70	EUR	200,70		19.066,50	0,3%
AMADEUS, SA, SM	180,00	59,56	EUR	59,56		10.720,80	0,2%
ANGLO AMERICAN, LN, GBP	350,00	24,24	GBP	26,97		9.438,78	0,1%
ANHEUSER-BUSCH INBEV, BB	407,00	57,01	EUR	57,01		23.203,07	0,3%
ASML HOLDING, NA	202,00	397,55	EUR	397,55		80.305,10	1,2%
AXA, FP	401,00	19,51	EUR	19,51		7.824,31	0,1%
BANCO SANTANDER, SM	10.431,00	2,54	EUR	2,54		26.473,88	0,4%
BASF, GY	405,00	64,72	EUR	64,72		26.211,60	0,4%
BAYER, GY	805,00	48,16	EUR	48,16		38.764,78	0,6%
BMW, GY	330,00	72,23	EUR	72,23		23.835,90	0,4%
BNP PARIBAS, FP	745,00	43,11	EUR	43,11		32.113,23	0,5%
BOUYGUES, FP	242,00	33,65	EUR	33,65		8.143,30	0,1%
CREDIT AGRICOLE, FP	1.722,00	10,32	EUR	10,32		17.771,04	0,3%
CRH, ID	349,00	34,02	EUR	34,02		11.872,98	0,2%
DAIMLER, GY	222,00	57,79	EUR	57,79		12.829,38	0,2%
DANONE, FP	323,00	53,76	EUR	53,76		17.364,48	0,3%
DASSAULT, FP	54,00	166,15	EUR	166,15		8.972,10	0,1%
DEUTSCHE BANK, GY	2.194,00	8,95	EUR	8,95		19.634,11	0,3%
DEUTSCHE POST, GY	868,00	40,50	EUR	40,50		35.154,00	0,5%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	2.045,00	14,96	EUR	14,96		30.582,98	0,5%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
DSM, NA	121,00	140,80	EUR	140,80		17.036,80	0,3%
E.ON, GY	928,00	9,06	EUR	9,06		8.411,39	0,1%
ENEL, IM	3.079,00	8,28	EUR	8,28		25.481,80	0,4%
ENI SPA, IM	633,00	8,55	EUR	8,55		5.410,88	0,1%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	745,00	24,94	EUR	24,94		18.580,30	0,3%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	122,00	127,55	EUR	127,55		15.561,10	0,2%
ESSITY AB, SS, SEK	369,00	264,50	SEK	26,36		9.726,69	0,1%
FERROVIAL, SM	266,00	22,60	EUR	22,60		6.011,60	0,1%
FIAT CHRYSLER, IM	619,00	14,66	EUR	14,66		9.074,54	0,1%
FRESENIUS, GY	328,00	37,84	EUR	37,84		12.411,52	0,2%
HERMES, FP	13,00	879,60	EUR	879,60		11.434,80	0,2%
IBERDROLA, SM	2.233,00	11,70	EUR	11,70		26.126,10	0,4%
ILIAD, FP	87,00	168,10	EUR	168,10		14.624,70	0,2%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	709,00	26,04	EUR	26,04		18.462,36	0,3%
INFINEON, GY	585,00	31,39	EUR	31,39		18.363,15	0,3%
KBC GROUP NV, BB	410,00	57,28	EUR	57,28		23.484,80	0,4%
KERING, FP	35,00	594,40	EUR	594,40		20.804,00	0,3%
L' OREAL, FP	150,00	310,80	EUR	310,80		46.620,00	0,7%
LVMH, FP	134,00	510,90	EUR	510,90		68.460,60	1,0%
MICHELIN, FP	74,00	104,95	EUR	104,95		7.766,30	0,1%
NESTE OYJ, FH	189,00	59,16	EUR	59,16		11.181,24	0,2%
NOKIA, FH	1.643,00	3,15	EUR	3,15		5.177,09	0,1%
OCADO, LN, GBP	484,00	22,87	GBP	25,44		12.312,25	0,2%
PERNOD-RICARD, FP	150,00	156,80	EUR	156,80		23.520,00	0,4%
PROSUS NV, NA	221,00	88,36	EUR	88,36		19.527,56	0,3%
PSA PEUGEOT, FP	797,00	22,37	EUR	22,37		17.828,89	0,3%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	134,00	65,42	GBP	72,77		9.750,82	0,1%
REPSOL, SM	686,00	8,25	EUR	8,25		5.659,50	0,1%
SAFRAN, FP	75,00	115,95	EUR	115,95		8.696,25	0,1%
SAMPO OYJ, FH	694,00	34,57	EUR	34,57		23.991,58	0,4%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	460,00	78,70	EUR	78,70		36.202,00	0,5%
SAP, GY	392,00	107,22	EUR	107,22		42.030,24	0,6%
SCHNEIDER, FP	124,00	118,30	EUR	118,30		14.669,20	0,2%
SIEMENS ENERGY AG, GY	219,00	30,00	EUR	30,00		6.570,00	0,1%
SIEMENS HEALTHINEERS, GY	314,00	41,98	EUR	41,98		13.181,72	0,2%
SIEMENS, GY	439,00	117,52	EUR	117,52		51.591,28	0,8%
ST.GOBAIN, FP	361,00	37,50	EUR	37,50		13.537,50	0,2%
TELECOM ITALIA, IM	19.952,00	0,38	EUR	0,38		7.529,88	0,1%
TELEFONICA, SM	1.695,00	3,25	EUR	3,25		5.500,28	0,1%
TELEPERFORMANCE, FP	33,00	271,30	EUR	271,30		8.952,90	0,1%
TOTAL FINA, FP	1.078,00	35,30	EUR	35,30		38.053,40	0,6%
UNICREDIT, IM	2.069,00	7,65	EUR	7,65		15.823,71	0,2%
VINCI, FP	259,00	81,36	EUR	81,36		21.072,24	0,3%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	9.335,77	0,1%
1.3.4. Acções					0,00	9.335,77	0,1%
ZURICH INSURANCE GROUP, VX, CHF	27,00	373,50	CHF	345,77		9.335,77	0,1%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						3.091.304,41	46,4%
3.1. Fundos Harmonizados						3.091.304,41	46,4%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	5.664,00	223,97	EUR	223,97		1.268.566,08	19,0%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	1.395,00	142,07	EUR	142,07		198.187,65	3,0%
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM)	1.830,00	39,83	EUR	39,83		72.888,90	1,1%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM)	446,00	81,30	EUR	81,30		36.259,80	0,5%
ISHARES USD CORP BND EUR-H D (FIM)	19.093,00	5,28	EUR	5,28		100.820,59	1,5%
NORDEA 1 EUR GHG YLD-BI-EUR	3.579,00	39,18	EUR	39,18		140.225,22	2,1%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	7.107,00	179,31	EUR	179,31		1.274.356,17	19,1%
4. Imobiliário						56.204,23	0,8%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						56.204,23	0,8%
CAIXAGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	13.943,00	4,03	EUR	4,03		56.204,23	0,8%
5. Liquidez						139.431,06	2,1%
5.1. À Vista					0,00	139.431,06	2,1%
Depósitos à Ordem					0,00	139.431,06	2,1%
9. Outros Activos						-752.101,08	-11,3%
9.1. Outros Devedores E Credores						-752.101,08	-11,3%
Juros de D.O. a Regularizar						148,76	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	-743.576,97	-11,2%
Impostos a Regularizar						2.665,57	0,0%
Comissões						-11.338,44	-0,2%

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

6.660.544,91
968.264,00
6,87885

O património do Fundo será representado por investimentos, preferencialmente expressos em euros e no máximo de 10% em outras moedas, nos seguintes instrumentos:

- a) Acções e respectivos derivados, admitidos à negociação em bolsas de valores ou em mercados regulamentados de Estados membros da União Europeia ou de outros Estados membros da OCDE, ou participações em instituições de investimento colectivo que invistam maioritariamente em acções, até ao máximo de 40%;
- b) Imóveis ou fundos de investimento imobiliários e respectivos derivados numa percentagem máxima de 40%;
- c) O remanescente, em instrumentos de rendimento fixo legalmente disponíveis, nomeadamente, obrigações, participações em instituições de investimento colectivo que não invistam maioritariamente em acções, depósitos bancários e outros activos de natureza monetária, bem como derivados associados a este tipo de activos;
- d) Operações de reporte e de empréstimo de valores, sem prejuízo do disposto nas alíneas anteriores.

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	
2008	-14,84%	4,49%	1 Ano	1,16%
2009	9,71%	5,09%	3 Anos	0,13%
2010	-1,76%	5,64%	5 Anos	0,18%
2011	-3,11%	5,83%	Desde o Início	1,46%
2012	9,45%	4,00%		
2013	5,34%	3,46%		
2014	2,71%	4,06%		
2015	1,71%	4,74%		
2016	-0,90%	4,40%		
2017	1,44%	2,21%		
2018	-5,22%	3,45%		
2019	4,70%	2,85%		
2020	1,16%	8,91%		

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

O produto tem uma volatilidade anual que se situa na classe 3 (Risco Médio/Baixo), conforme quadro anexo.

Classe de Risco	Escalão de Risco	Volatilidade
1	Risco Muito Baixo	< 0,5%
2	Risco Baixo	0,5% - 2%
3	Risco Médio/Baixo	2% - 5%
4	Risco Médio	5% - 10%
5	Risco Médio/Alto	10% - 15%
6	Risco Alto	15% - 25%
7	Risco Muito Alto	>25%