

CAIXA PPR INVESTIMENTO

30 abril 2023

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 na data de referência, 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)
Parte I - Valores Patrimoniais					15,473.87	4,780,175.34
1. Valores Mobiliários Cotados					15,473.87	2,809,877.58
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					0.00	0.00
1.1.4. Acções						0.00
BANIF, PL	126.00	0.00	EUR	0.00		0.00
BES, PL (EM LIQUIDACAO)	40,936.00	0.00	EUR	0.00		0.00
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					15,473.87	2,770,167.25
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					14,738.15	1,791,682.09
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	167,000.00	93.93%	EUR	93.93%	3,766.42	160,631.19
BKO, 0.2%, 24/06/2024, GOVT	200,000.00	97.09%	EUR	97.09%	380.27	194,564.27
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	42,000.00	56.61%	EUR	56.61%	118.35	23,892.87
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	65,000.00	74.73%	EUR	74.73%	0.00	48,573.20
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	56,000.00	72.61%	EUR	72.61%	0.00	40,660.48
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	119,000.00	52.78%	EUR	52.78%	0.00	62,802.25
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	3,000.00	88.83%	EUR	88.83%	1.54	2,666.32
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	8,000.00	92.45%	EUR	92.45%	28.38	7,424.06
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	303,000.00	81.77%	EUR	81.77%	0.00	247,775.22
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	101,000.00	80.50%	EUR	80.50%	0.00	81,306.01
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	113,000.00	91.68%	EUR	91.68%	121.51	103,722.17
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	50,000.00	83.50%	EUR	83.50%	583.90	42,331.40
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	227,000.00	100.48%	EUR	100.48%	4,969.12	233,051.91
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	30,000.00	47.80%	EUR	47.80%	0.00	14,339.10
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	140,000.00	113.62%	EUR	113.62%	1,524.66	160,598.26
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	2,000.00	91.13%	EUR	91.13%	11.92	1,834.48
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	14,000.00	93.86%	EUR	93.86%	0.00	13,140.12
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	15,000.00	56.73%	EUR	56.73%	12.91	8,521.81
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	200,000.00	93.51%	EUR	93.51%	793.15	187,817.15
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	10,000.00	61.91%	EUR	61.91%	75.34	6,266.34
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	160,000.00	92.13%	EUR	92.13%	2,350.68	149,763.48
1.2.3. Obrigações Diversas					735.72	55,176.12
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	105,000.00	51.85%	EUR	51.85%	735.72	55,176.12
1.2.4. Acções						923,309.04
ADIDAS, GY	71.00	159.38	EUR	159.38		11,315.98
AHOLD DELHAIZE, NA	224.00	31.20	EUR	31.20		6,988.80
AIR LIQUIDE, FP	146.00	162.58	EUR	162.58		23,736.68
AIRBUS GROUP, FP	192.00	126.52	EUR	126.52		24,291.84
ALLIANZ, GY	65.00	226.70	EUR	226.70		14,735.50
AMADEUS, SA, SM	196.00	63.56	EUR	63.56		12,457.76
ASML HOLDING, NA	120.00	572.80	EUR	572.80		68,736.00
ASR NEDERLAND NV, NA	134.00	39.94	EUR	39.94		5,351.96
AXA, FP	646.00	29.55	EUR	29.55		19,089.30
BANCO SABADELL, SM	6,734.00	0.95	EUR	0.95		6,379.79
BANCO SANTANDER, SM	4,967.00	3.17	EUR	3.17		15,762.77
BASF, GY	300.00	46.66	EUR	46.66		13,996.50
BAYER, GY	273.00	59.65	EUR	59.65		16,284.45
BMW, GY	85.00	100.86	EUR	100.86		8,573.10
BNP PARIBAS, FP	159.00	58.26	EUR	58.26		9,263.34
CAIXABANK SA, SM	3,003.00	3.35	EUR	3.35		10,051.04
CAP GEMINI, FP	83.00	164.65	EUR	164.65		13,665.95
CARREFOUR, FP	320.00	18.86	EUR	18.86		6,033.60
CELLNEX TELECOM, SM	168.00	38.22	EUR	38.22		6,420.96
COMMERZBANK, GY	602.00	10.03	EUR	10.03		6,038.06
CRH, ID	286.00	43.59	EUR	43.59		12,466.74
DANONE, FP	109.00	59.71	EUR	59.71		6,508.39
DEUTSCHE BOERSE, GY	40.00	173.10	EUR	173.10		6,924.00
DEUTSCHE POST, GY	300.00	43.40	EUR	43.40		13,020.00
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1,117.00	21.82	EUR	21.82		24,367.36
DSM, NA	51.00	117.60	EUR	117.60		5,997.60
ENEL, IM	2,956.00	6.21	EUR	6.21		18,344.94
ENI SPA, IM	799.00	13.74	EUR	13.74		10,978.26
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	265.00	32.99	EUR	32.99		8,742.35
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13.00	0.00	EUR	0.00		0.00
ESSILOR, FP	67.00	178.54	EUR	178.54		11,962.18
ESSITY AB, SS, SEK	172.00	310.40	SEK	27.34		4,703.24
FERROVIAL, SM	175.00	28.38	EUR	28.38		4,966.50
FINECOBANK SPA, IM	906.00	13.67	EUR	13.67		12,380.49
HERMES, FP	13.00	1,962.20	EUR	1,962.20		25,508.60
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	376.00	31.03	EUR	31.03		11,667.28
INFINEON, GY	150.00	32.75	EUR	32.75		4,912.50
ING Groep, NA	1,465.00	11.16	EUR	11.16		16,355.26
KERING, FP	11.00	578.30	EUR	578.30		6,361.30

	KONINKLIJKE PHILIPS NV, NA	307.00	19.06	EUR	19.06	5,851.42
	L' OREAL, FP	62.00	431.70	EUR	431.70	26,765.40
	LVMH, FP	73.00	868.60	EUR	868.60	63,407.80
	MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	230.00	70.20	EUR	70.20	16,146.00
	MERCK KGAA, GY	36.00	162.05	EUR	162.05	5,833.80
	MICHELIN, FP	291.00	28.68	EUR	28.68	8,345.88
	NESTE OYJ, FH	143.00	43.87	EUR	43.87	6,273.41
	NOKIA, FH	2,787.00	3.83	EUR	3.83	10,678.39
	PERNOD-RICARD, FP	72.00	208.40	EUR	208.40	15,004.80
	PROSUS NV, NA	136.00	67.80	EUR	67.80	9,220.80
	RWE, GY	165.00	42.48	EUR	42.48	7,009.20
	SAFRAN, FP	42.00	140.38	EUR	140.38	5,895.96
	SAMPO OYJ, FH	120.00	45.97	EUR	45.97	5,516.40
	SANOFI-SYNTHELABO, FP	251.00	100.00	EUR	100.00	25,100.00
	SAP, GY	195.00	122.88	EUR	122.88	23,961.60
	SCHNEIDER, FP	103.00	157.62	EUR	157.62	16,234.86
	SHELL PLC, NA	158.00	28.04	EUR	28.04	4,429.53
	SIEMENS, GY	234.00	148.44	EUR	148.44	34,734.96
	SOCIETE GENERALE, FP	570.00	21.91	EUR	21.91	12,488.70
	ST.GOBAIN, FP	247.00	52.27	EUR	52.27	12,910.69
	TELE2 AB-B SHS, SS, SEK	349.00	108.80	SEK	9.58	3,345.04
	TELEFONICA, SM	1,990.00	4.13	EUR	4.13	8,210.74
	TELEPERFORMANCE, FP	27.00	180.00	EUR	180.00	4,860.00
	THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	53.00	138.25	EUR	138.25	7,327.25
	TOTALENERGIES SE, FP	532.00	57.74	EUR	57.74	30,717.68
	UNICREDIT, IM	1,020.00	17.92	EUR	17.92	18,280.44
	VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	220.00	28.63	EUR	28.63	6,298.60
	VINCI, FP	142.00	111.94	EUR	111.94	15,895.48
	VONOVIA SE, GY	368.00	19.63	EUR	19.63	7,223.84
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0.00
1.3.4.	Acções					0.00
	ASHTED GROUP, LN, GBP	77.00	45.52	GBP	51.70	3,980.74
	CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	40.00	146.86	CHF	149.26	5,970.53
	GLENCORE XSTRATA, LN, GBP	817.00	4.69	GBP	5.32	4,350.37
	OCADO, LN, GBP	754.00	5.02	GBP	5.70	4,295.36
	RECKITT BENCKISER, LN, GBP	85.00	64.32	GBP	73.05	6,209.20
	STELLANTIS NV, IM	998.00	14.93	EUR	14.93	14,904.13
3.	Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					1,784,686.97
3.1.	Fundos Harmonizados					1,784,686.97
	BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	3,954.42	195.10	EUR	195.10	771,506.37
	ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	684.00	107.14	EUR	107.14	73,283.76
	ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	555.00	46.03	EUR	46.03	25,546.65
	ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM), ETF	287.00	88.16	EUR	88.16	25,301.92
	VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	4,975.90	153.96	EUR	153.96	766,089.41
	X MSCI JAPAN EUR, FIM, ETF	1,827.00	26.80	EUR	26.80	48,969.08
	X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	753.00	98.26	EUR	98.26	73,989.78
4.	Imobiliário					101,629.33
4.2.	Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário					101,629.33
	CAIXAGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	7,350.00	4.23	EUR	4.23	31,126.52
	FUNDIMO (FII)	8,427.00	8.37	EUR	8.37	70,502.81
5.	Liquidez					80,814.22
5.1.	À Vista					0.00
	Depósitos à Ordem					0.00
9.	Outros Activos					3,167.24
9.1.	Outros Devedores E Credores					3,167.24
	Juros de D.O. a Regularizar					128.84
	Transacções a Liquidar					3,135.36
	Impostos a Regularizar					7,790.55
	Comissões					-7,887.51

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

4,780,175.34

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

779,415.04

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6.13

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	-16,17%
2009	9,71%	5,09%	3 Anos	-4,55%
2010	-1,76%	5,64%	5 Anos	-2,90%
2011	-3,11%	5,83%	Desde o Inicio	0,71%
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%		
2021	2,55%	2,97%		
2022	-16,17%	8,04%		

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