

CAIXA PPR INVESTIMENTO

30 junho 2022

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 30/06/2022, 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					13.861,71	5.318.176,86	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					13.861,71	2.912.326,46	54,8%
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.					13.861,71	2.864.382,68	53,9%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					13.812,29	1.846.688,20	34,7%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	55.000,00	104,24%	EUR	104,24%	141,04	57.472,49	1,1%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	77.000,00	67,14%	EUR	67,14%	433,96	52.133,30	1,0%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	256.000,00	80,72%	EUR	80,72%	0,00	206.653,44	3,9%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	119.000,00	64,05%	EUR	64,05%	0,00	76.218,31	1,4%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	153.000,00	94,48%	EUR	94,48%	142,52	144.696,92	2,7%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	208.000,00	97,41%	EUR	97,41%	911,78	203.514,18	3,8%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	203.000,00	88,02%	EUR	88,02%	0,00	178.670,45	3,4%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	101.000,00	85,67%	EUR	85,67%	0,00	86.524,68	1,6%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	113.000,00	95,66%	EUR	95,66%	168,73	108.262,27	2,0%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	50.000,00	91,21%	EUR	91,21%	63,36	45.667,86	0,9%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	310.000,00	104,98%	EUR	104,98%	8.987,88	334.435,18	6,3%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	169.000,00	97,34%	EUR	97,34%	0,00	164.504,60	3,1%
RAGB, 0%, 15/07/2023, GOVT	20.000,00	99,39%	EUR	99,39%	0,00	19.878,60	0,4%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	10.000,00	71,87%	EUR	71,87%	90,91	7.278,21	0,1%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	160.000,00	98,69%	EUR	98,69%	2.872,11	160.777,71	3,0%
1.2.3. Obrigações Diversas					49,42	40.608,12	0,8%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	65.000,00	62,40%	EUR	62,40%	49,42	40.608,12	0,8%
1.2.4. Acções						977.086,36	18,4%
ADIDAS, GY	52,00	168,76	EUR	168,76		8.775,52	0,2%
AHOLD DELHAIZE, NA	430,00	24,86	EUR	24,86		10.689,80	0,2%
AIR LIQUIDE, FP	214,00	128,12	EUR	128,12		27.417,68	0,5%
AIRBUS GROUP, FP	252,00	92,45	EUR	92,45		23.297,40	0,4%
AKZO NOBEL, NA	108,00	62,62	EUR	62,62		6.762,96	0,1%
ALLIANZ, GY	85,00	182,12	EUR	182,12		15.480,20	0,3%
AMADEUS, SA, SM	256,00	53,16	EUR	53,16		13.608,96	0,3%
ASML HOLDING, NA	157,00	455,85	EUR	455,85		71.568,45	1,3%
ASR NEDERLAND NV, NA	269,00	38,57	EUR	38,57		10.375,33	0,2%
ASSICURAZIONI GENERALI, IM	544,00	15,23	EUR	15,23		8.282,40	0,2%
AXA, FP	251,00	21,66	EUR	21,66		5.436,66	0,1%
BANCO SANTANDER, SM	4.214,00	2,69	EUR	2,69		11.327,23	0,2%
BASF, GY	320,00	41,53	EUR	41,53		13.288,00	0,2%
BAYER, GY	356,00	56,72	EUR	56,72		20.192,32	0,4%
BMW, GY	111,00	73,46	EUR	73,46		8.154,06	0,2%
BNP PARIBAS, FP	208,00	45,37	EUR	45,37		9.435,92	0,2%
CAIXABANK SA, SM	6.347,00	3,32	EUR	3,32		21.053,00	0,4%
CAP GEMINI, FP	108,00	163,45	EUR	163,45		17.652,60	0,3%
CARREFOUR, FP	417,00	16,89	EUR	16,89		7.041,05	0,1%
COMMERZBANK, GY	702,00	6,69	EUR	6,69		4.693,57	0,1%
CRH, ID	365,00	33,00	EUR	33,00		12.045,00	0,2%
DANONE, FP	142,00	53,26	EUR	53,26		7.562,92	0,1%
DEUTSCHE BOERSE, GY	81,00	159,60	EUR	159,60		12.927,60	0,2%
DEUTSCHE POST, GY	446,00	35,74	EUR	35,74		15.940,04	0,3%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1.648,00	18,95	EUR	18,95		31.223,01	0,6%
DSM, NA	37,00	137,10	EUR	137,10		5.072,70	0,1%
E.ON, GY	780,00	8,01	EUR	8,01		6.246,24	0,1%
ENEL, IM	2.407,00	5,22	EUR	5,22		12.564,54	0,2%
ENI SPA, IM	1.044,00	11,33	EUR	11,33		11.826,43	0,2%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	542,00	24,20	EUR	24,20		13.116,40	0,2%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	87,00	142,90	EUR	142,90		12.432,30	0,2%
ESSITY AB, SS, SEK	225,00	267,10	SEK	24,89		5.600,89	0,1%
FERROVIAL, SM	229,00	24,19	EUR	24,19		5.539,51	0,1%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
HERMES, FP	14,00	1.067,00	EUR	1.067,00		14.938,00	0,3%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	524,00	21,59	EUR	21,59		11.313,16	0,2%
INFINEON, GY	196,00	23,09	EUR	23,09		4.525,64	0,1%
ING Groep, NA	2.738,00	9,43	EUR	9,43		25.822,08	0,5%
KERING, FP	24,00	490,10	EUR	490,10		11.762,40	0,2%
KONINKLIJKE PHILIPS NV, NA	403,00	20,56	EUR	20,56		8.283,67	0,2%
L' OREAL, FP	82,00	329,30	EUR	329,30		27.002,60	0,5%
LVMH, FP	95,00	581,70	EUR	581,70		55.261,50	1,0%
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	300,00	55,22	EUR	55,22		16.566,00	0,3%
MERCK KGAA, GY	46,00	161,00	EUR	161,00		7.406,00	0,1%
MICHELIN, FP	380,00	25,98	EUR	25,98		9.870,50	0,2%
NOKIA, FH	3.644,00	4,44	EUR	4,44		16.177,54	0,3%
PERNOD-RICARD, FP	93,00	175,30	EUR	175,30		16.302,90	0,3%
RWE, GY	217,00	35,08	EUR	35,08		7.612,36	0,1%
SAFRAN, FP	55,00	94,21	EUR	94,21		5.181,55	0,1%
SAMPO OYJ, FH	275,00	41,52	EUR	41,52		11.418,00	0,2%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	328,00	96,34	EUR	96,34		31.599,52	0,6%
SAP, GY	255,00	86,93	EUR	86,93		22.167,15	0,4%
SCHNEIDER, FP	135,00	112,90	EUR	112,90		15.241,50	0,3%
SHELL PLC, NA	207,00	24,85	EUR	24,85		5.142,92	0,1%
SIEMENS, GY	307,00	97,09	EUR	97,09		29.806,63	0,6%
SOCIETE GENERALE, FP	829,00	20,89	EUR	20,89		17.317,81	0,3%
ST.GOBAIN, FP	323,00	40,95	EUR	40,95		13.225,24	0,2%
TELEFONICA, SM	3.271,00	4,86	EUR	4,86		15.903,60	0,3%
TELEPERFORMANCE, FP	18,00	293,30	EUR	293,30		5.279,40	0,1%
THALES (EX -THOMSON) ,FP,FRF)	83,00	117,05	EUR	117,05		9.715,15	0,2%
TOTALENERGIES SE, FP	736,00	50,37	EUR	50,37		37.072,32	0,7%
UNICREDIT, IM	2.135,00	9,07	EUR	9,07		19.353,78	0,4%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	381,00	19,13	EUR	19,13		7.290,05	0,1%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	288,00	23,29	EUR	23,29		6.707,52	0,1%
VINCI, FP	187,00	84,96	EUR	84,96		15.887,52	0,3%
VOLKSWAGEN PFD, GY	73,00	127,42	EUR	127,42		9.301,66	0,2%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	47.943,78	0,9%
1.3.4. Acções					0,00	47.943,78	0,9%
ASHTED GROUP, LN, GBP	101,00	34,39	GBP	40,07		4.047,30	0,1%
BP AMOCO,PLC, LN, GBP	1.126,00	3,88	GBP	4,52		5.094,68	0,1%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	53,00	101,65	CHF	102,06		5.409,09	0,1%
GLENCORE XSTRATA, LN, GBP	1.029,00	4,45	GBP	5,19		5.336,84	0,1%
OCADO, LN, GBP	507,00	7,81	GBP	9,10		4.615,11	0,1%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	112,00	61,70	GBP	71,89		8.052,20	0,2%
STELLANTIS NV, IM	1.305,00	11,79	EUR	11,79		15.388,56	0,3%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						2.226.806,15	41,9%
3.1. Fundos Harmonizados						2.226.806,15	41,9%
BNP EURO CORPORATE BDJ (FIM)	5.231,86	193,59	EUR	193,59		1.012.836,55	19,0%
ISHARES EUROSXXX UCITS ETF DE (FIM)	2.025,00	38,59	EUR	38,59		78.134,63	1,5%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM)	648,00	81,72	EUR	81,72		52.954,56	1,0%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	6.604,07	154,83	EUR	154,83		1.022.507,85	19,2%
X MSCI JAPAN EUR, FIM	2.527,00	23,89	EUR	23,89		60.372,56	1,1%
4. Imobiliário						132.944,17	2,5%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						132.944,17	2,5%
CAIXGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	13.943,00	4,62	EUR	4,62		64.380,41	1,2%
FUNDIMO (FII)	8.427,00	8,14	EUR	8,14		68.563,76	1,3%
5. Liquidez						48.872,52	0,9%
5.1. À Vista					0,00	48.872,52	0,9%
Depósitos à Ordem					0,00	48.872,52	0,9%
9. Outros Activos						-2.772,44	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores						-2.772,44	-0,1%
Juros de D.O. a Regularizar						147,30	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	412,90	0,0%
Impostos a Regularizar						5.550,98	0,1%
Comissões						-8.883,62	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA 5.318.176,86
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO 875.668,00
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO 6,07

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 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%