

CAIXA PPR INVESTIMENTO

31 outubro 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)	Peso
Parte I - Valores Patrimoniais					8.180,62	4.450.124,34	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					8.180,62	2.623.927,93	59,0%
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 (EM LIQUIDACAO)	40.936,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					8.180,62	2.607.112,72	58,6%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					8.180,62	1.745.792,37	39,2%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	167.000,00	90,63%	EUR	90,63%	1.774,03	153.122,79	3,4%
BKO, 0.2%, 24/06/2024, GOVT	200.000,00	97,91%	EUR	97,91%	153,01	195.979,01	4,4%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	42.000,00	51,54%	EUR	51,54%	119,65	21.764,77	0,5%
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	65.000,00	71,71%	EUR	71,71%	0,00	46.613,45	1,0%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	56.000,00	69,29%	EUR	69,29%	0,00	38.804,08	0,9%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	119.000,00	44,97%	EUR	44,97%	0,00	53.508,35	1,2%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	3.000,00	88,50%	EUR	88,50%	5,32	2.660,44	0,1%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	118.000,00	92,32%	EUR	92,32%	125,87	109.061,11	2,5%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	303.000,00	80,14%	EUR	80,14%	0,00	242.830,26	5,5%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	101.000,00	80,03%	EUR	80,03%	0,00	80.834,34	1,8%
FRTR, 0%, 25/03/2025, GOVT	30.000,00	95,50%	EUR	95,50%	0,00	28.650,30	0,6%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	113.000,00	91,92%	EUR	91,92%	263,92	104.134,65	2,3%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	105.000,00	44,84%	EUR	44,84%	344,26	47.421,01	1,1%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	50.000,00	80,65%	EUR	80,65%	273,22	40.598,72	0,9%
FRTR, CZ, 25/11/2029, GOVT	66.000,00	83,20%	EUR	83,20%	0,00	54.912,66	1,2%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	30.000,00	40,75%	EUR	40,75%	0,00	12.223,80	0,3%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	140.000,00	105,08%	EUR	105,08%	4.171,23	151.277,63	3,4%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	2.000,00	90,66%	EUR	90,66%	4,47	1.817,71	0,0%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	14.000,00	94,39%	EUR	94,39%	0,00	13.214,60	0,3%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	15.000,00	49,86%	EUR	49,86%	69,47	7.548,02	0,2%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	200.000,00	93,54%	EUR	93,54%	49,18	187.125,18	4,2%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	10.000,00	57,52%	EUR	57,52%	25,68	5.777,78	0,1%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	160.000,00	90,69%	EUR	90,69%	801,31	145.911,71	3,3%
1.2.4. Acções						861.320,35	19,4%
ADIDAS, GY	69,00	167,02	EUR	167,02		11.524,38	0,3%
ADYEN NV, NA	7,00	633,90	EUR	633,90		4.437,30	0,1%
AHOLD DELHAIZE, NA	229,00	28,00	EUR	28,00		6.412,00	0,1%
AIR LIQUIDE, FP	166,00	161,62	EUR	161,62		26.828,92	0,6%
AIRBUS GROUP, FP	187,00	126,26	EUR	126,26		23.610,62	0,5%
ALLIANZ, GY	63,00	221,05	EUR	221,05		13.926,15	0,3%
AMADEUS, SA, SM	191,00	53,82	EUR	53,82		10.279,62	0,2%
ASML HOLDING, NA	113,00	565,20	EUR	565,20		63.867,60	1,4%
ASR NEDERLAND NV, NA	131,00	35,20	EUR	35,20		4.611,20	0,1%
AXA, FP	629,00	27,95	EUR	27,95		17.580,55	0,4%
BANCO SABADELL, SM	6.561,00	1,17	EUR	1,17		7.682,93	0,2%
BANCO SANTANDER, SM	4.839,00	3,47	EUR	3,47		16.769,55	0,4%
BASF, GY	136,00	43,38	EUR	43,38		5.899,68	0,1%
BAYER, GY	266,00	40,56	EUR	40,56		10.788,96	0,2%
BMW, GY	83,00	87,34	EUR	87,34		7.249,22	0,2%
BNP PARIBAS, FP	155,00	54,29	EUR	54,29		8.414,95	0,2%
CAIXABANK SA, SM	2.926,00	3,84	EUR	3,84		11.221,21	0,3%
CAP GEMINI, FP	81,00	166,50	EUR	166,50		13.486,50	0,3%
CARREFOUR, FP	312,00	16,58	EUR	16,58		5.172,96	0,1%
CELLNEX TELECOM, SM	194,00	27,71	EUR	27,71		5.375,74	0,1%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	39,00	106,90	CHF	111,27		4.339,65	0,1%
COMMERZBANK, GY	587,00	10,14	EUR	10,14		5.952,18	0,1%
CRH, LN, GBP	244,00	44,21	GBP	50,60		12.347,18	0,3%
DANONE, FP	106,00	56,14	EUR	56,14		5.950,84	0,1%
DEUTSCHE BOERSE, GY	39,00	155,00	EUR	155,00		6.045,00	0,1%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	987,00	20,43	EUR	20,43		20.164,41	0,5%
DHL GROUP, GY	292,00	36,67	EUR	36,67		10.707,64	0,2%
DSM-FIRMENICH AG, NA	109,00	85,57	EUR	85,57		9.327,13	0,2%
ENEL, IM	2.880,00	5,99	EUR	5,99		17.242,56	0,4%
ENI SPA, IM	778,00	15,42	EUR	15,42		11.998,32	0,3%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	258,00	33,84	EUR	33,84		8.730,72	0,2%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	65,00	170,62	EUR	170,62		11.090,30	0,2%
ESSITY AB, SS, SEK	216,00	254,40	SEK	21,51		4.645,99	0,1%
FERROVIAL, SE	175,00	28,39	EUR	28,39		4.968,25	0,1%
FINECOBANK SPA, IM	883,00	11,12	EUR	11,12		9.814,55	0,2%
HEIDELBERCEMENT, GY	61,00	68,36	EUR	68,36		4.169,96	0,1%
HERMES, FP	13,00	1.759,40	EUR	1.759,40		22.872,20	0,5%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	366,00	32,55	EUR	32,55		11.913,30	0,3%
INFINEON, GY	302,00	27,44	EUR	27,44		8.286,88	0,2%
ING Groep, NA	1.427,00	12,03	EUR	12,03		17.161,10	0,4%
KERING, FP	11,00	383,15	EUR	383,15		4.214,65	0,1%
KONINKLIJKE PHILIPS NV, NA	312,00	17,90	EUR	17,90		5.584,18	0,1%
L' OREAL, FP	60,00	396,10	EUR	396,10		23.766,00	0,5%
LVMH, FP	71,00	674,50	EUR	674,50		47.889,50	1,1%

Designação		Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
	MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	224,00	55,23	EUR	55,23		12.371,52	0,3%
	MERCK KGAA, GY	36,00	141,60	EUR	141,60		5.097,60	0,1%
	MICHELIN, FP	284,00	28,02	EUR	28,02		7.957,68	0,2%
	NESTE OYJ, FH	139,00	31,62	EUR	31,62		4.395,18	0,1%
	PERNOD-RICARD, FP	72,00	167,50	EUR	167,50		12.060,00	0,3%
	PROSUS NV, NA	289,00	26,43	EUR	26,43		7.638,27	0,2%
	RWE, GY	161,00	36,18	EUR	36,18		5.824,98	0,1%
	SAFRAN, FP	41,00	147,00	EUR	147,00		6.027,00	0,1%
	SAMPO OYJ, FH	117,00	37,12	EUR	37,12		4.343,04	0,1%
	SANOFI-SYNTHELABO, FP	245,00	85,69	EUR	85,69		20.994,05	0,5%
	SAP, GY	190,00	126,56	EUR	126,56		24.046,40	0,5%
	SCHNEIDER, FP	100,00	144,98	EUR	144,98		14.498,00	0,3%
	SIEMENS, GY	228,00	124,70	EUR	124,70		28.431,60	0,6%
	SOCIETE GENERALE, FP	413,00	21,14	EUR	21,14		8.730,82	0,2%
	ST.GOBAIN, FP	241,00	51,39	EUR	51,39		12.384,99	0,3%
	STELLANTIS NV, IM	972,00	17,60	EUR	17,60		17.105,26	0,4%
	STMICROELECTRONICS, FP	157,00	35,98	EUR	35,98		5.648,08	0,1%
	TELEFONICA, SM	1.059,00	3,65	EUR	3,65		3.860,06	0,1%
	TELEPERFORMANCE, FP	27,00	108,05	EUR	108,05		2.917,35	0,1%
	THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	52,00	139,10	EUR	139,10		7.233,20	0,2%
	TOTALENERGIES SE, FP	518,00	63,20	EUR	63,20		32.737,60	0,7%
	UNICREDIT, IM	781,00	23,63	EUR	23,63		18.451,13	0,4%
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	282,00	23,10	EUR	23,10		6.514,20	0,1%
	VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	214,00	25,83	EUR	25,83		5.527,62	0,1%
	VINCI, FP	138,00	104,46	EUR	104,46		14.415,48	0,3%
	VONOVIA SE, GY	359,00	21,69	EUR	21,69		7.786,71	0,2%
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	16.815,21	0,4%
1.3.4.	Acções					0,00	16.815,21	0,4%
	ASSTEAD GROUP, LN, GBP	75,00	47,03	GBP	53,83		4.037,33	0,1%
	OCADO, LN, GBP	527,00	4,65	GBP	5,32		2.804,92	0,1%
	RECKITT BENCKISER, LN, GBP	83,00	55,00	GBP	62,95		5.225,14	0,1%
	SHELL PLC, NA	154,00	30,83	EUR	30,83		4.747,82	0,1%
3.	Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.658.340,38	37,3%
3.1.	Fundos Harmonizados						1.658.340,38	37,3%
	BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	3.612,24	197,32	EUR	197,32		712.766,80	16,0%
	ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	684,00	105,35	EUR	105,35		72.059,40	1,6%
	ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	555,00	42,46	EUR	42,46		23.562,53	0,5%
	ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM), ETF	287,00	88,16	EUR	88,16		25.301,92	0,6%
	VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	4.638,52	153,57	EUR	153,57		712.336,75	16,0%
	X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1.241,00	90,50	EUR	90,50		112.312,98	2,5%
4.	Imobiliário						71.272,20	1,6%
4.2.	Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						71.272,20	1,6%
	FUNDIMO (FII)	8.427,00	8,46	EUR	8,46		71.272,20	1,6%
5.	Liquidez						94.962,80	2,1%
5.1.	À Vista					0,00	94.962,80	2,1%
	Depósitos à Ordem					0,00	94.962,80	2,1%
9.	Outros Activos						1.621,03	0,0%
9.1.	Outros Devedores E Credores						1.621,03	0,0%
	Juros de D.O. a Regularizar						153,77	0,0%
	Transacções a Liquidar					0,00	558,98	0,0%
	Impostos a Regularizar						8.506,51	0,2%
	Comissões						-7.598,23	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

4.450.124,34

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

745.596,01

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

5,97

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

- 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%;
- 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 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%