

## CAIXA PPR INVESTIMENTO

31 dezembro 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 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)
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>8.162,68</b>	<b>4.858.473,05</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>8.162,68</b>	<b>2.818.879,34</b>
<b>1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal</b>					<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>1.1.4. Acções</b>						<b>0,00</b>
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
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>8.162,68</b>	<b>2.769.713,32</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>7.685,86</b>	<b>1.772.462,21</b>
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	67.000,00	93,28%	EUR	93,28%	982,42	63.482,70
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	32.000,00	55,57%	EUR	55,57%	183,34	17.964,14
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	256.000,00	70,97%	EUR	70,97%	0,00	181.688,32
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	119.000,00	52,18%	EUR	52,18%	0,00	62.091,82
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	153.000,00	87,62%	EUR	87,62%	335,34	134.400,06
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	208.000,00	91,50%	EUR	91,50%	396,05	190.707,73
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	203.000,00	79,94%	EUR	79,94%	0,00	162.282,26
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	101.000,00	79,29%	EUR	79,29%	0,00	80.086,94
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	113.000,00	90,82%	EUR	90,82%	28,64	102.649,59
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	50.000,00	81,74%	EUR	81,74%	378,42	41.249,92
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	227.000,00	101,20%	EUR	101,20%	1.797,34	231.519,07
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	30.000,00	48,46%	EUR	48,46%	0,00	14.538,00
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	50.000,00	113,48%	EUR	113,48%	1.803,08	58.544,08
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	97.000,00	90,28%	EUR	90,28%	338,83	87.907,52
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	154.000,00	93,36%	EUR	93,36%	0,00	143.780,56
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	50.000,00	93,02%	EUR	93,02%	75,00	46.583,50
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	10.000,00	61,11%	EUR	61,11%	42,47	6.153,87
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	160.000,00	90,94%	EUR	90,94%	1.324,93	146.832,13
<b>1.2.3. Obrigações Diversas</b>					<b>476,82</b>	<b>55.254,27</b>
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	105.000,00	52,17%	EUR	52,17%	476,82	55.254,27
<b>1.2.4. Acções</b>						<b>941.996,84</b>
ADIDAS, GY	82,00	127,44	EUR	127,44		10.450,08
AHOLD DELHAIZE, NA	261,00	26,89	EUR	26,89		7.018,29
AIR LIQUIDE, FP	170,00	133,26	EUR	133,26		22.654,20
AIRBUS GROUP, FP	224,00	111,64	EUR	111,64		25.007,36
ALLIANZ, GY	76,00	201,10	EUR	201,10		15.283,60
AMADEUS, SA, SM	228,00	48,60	EUR	48,60		11.080,80
ASML HOLDING, NA	140,00	507,00	EUR	507,00		70.980,00
ASR NEDERLAND NV, NA	239,00	44,44	EUR	44,44		10.621,16
AXA, FP	223,00	26,16	EUR	26,16		5.833,68
BANCO SABADELL, SM	7.838,00	0,88	EUR	0,88		6.908,41
BANCO SANTANDER, SM	4.034,00	2,80	EUR	2,80		11.309,32
BASF, GY	348,00	46,50	EUR	46,50		16.182,00
BAYER, GY	317,00	48,53	EUR	48,53		15.384,01
BMW, GY	98,00	83,32	EUR	83,32		8.165,36
BNP PARIBAS, FP	185,00	53,48	EUR	53,48		9.893,80
CAIXABANK SA, SM	5.649,00	3,67	EUR	3,67		20.731,83
CAP GEMINI, FP	96,00	156,95	EUR	156,95		15.067,20
CARREFOUR, FP	372,00	15,62	EUR	15,62		5.810,64
CELLNEX TELECOM, SM	196,00	31,01	EUR	31,01		6.077,96
COMMERZBANK, GY	701,00	8,81	EUR	8,81		6.177,21
CRH, ID	333,00	37,01	EUR	37,01		12.324,33
DANONE, FP	127,00	49,41	EUR	49,41		6.274,44
DEUTSCHE BOERSE, GY	46,00	161,35	EUR	161,35		7.422,10
DEUTSCHE POST, GY	348,00	35,27	EUR	35,27		12.273,96
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1.300,00	18,68	EUR	18,68		24.289,20
DSM, NA	59,00	114,95	EUR	114,95		6.782,05
ENEL, IM	3.440,00	5,05	EUR	5,05		17.382,32
ENI SPA, IM	930,00	13,37	EUR	13,37		12.437,82
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	351,00	29,95	EUR	29,95		10.512,45
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00
ESSILOR, FP	78,00	169,85	EUR	169,85		13.248,30
ESSITY AB, SS, SEK	200,00	273,70	SEK	24,61		4.921,87
FERROVIAL, SM	204,00	24,60	EUR	24,60		5.018,40

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)
HERMES, FP	14,00	1.454,00	EUR	1.454,00		20.356,00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	437,00	24,90	EUR	24,90		10.881,30
INFINEON, GY	174,00	28,49	EUR	28,49		4.956,39
ING Groep, NA	2.437,00	11,44	EUR	11,44		27.874,41
KERING, FP	22,00	479,05	EUR	479,05		10.539,10
KONINKLUKE PHILIPS NV, NA	358,00	14,04	EUR	14,04		5.026,32
L' OREAL, FP	73,00	334,65	EUR	334,65		24.429,45
LVMH, FP	84,00	683,20	EUR	683,20		57.388,80
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	267,00	61,40	EUR	61,40		16.393,80
MERCK KGAA, GY	41,00	181,55	EUR	181,55		7.443,55
MICHELIN, FP	339,00	26,11	EUR	26,11		8.851,29
NESTE OYJ, FH	167,00	43,26	EUR	43,26		7.224,42
NOKIA, FH	3.243,00	4,35	EUR	4,35		14.094,08
PERNOD-RICARD, FP	83,00	184,80	EUR	184,80		15.338,40
RWE, GY	193,00	41,64	EUR	41,64		8.036,52
SAFRAN, FP	49,00	117,12	EUR	117,12		5.738,88
SAMPO OYJ, FH	245,00	48,95	EUR	48,95		11.992,75
SANOFI-SYNTHELABO, FP	292,00	90,15	EUR	90,15		26.323,80
SAP, GY	227,00	96,33	EUR	96,33		21.866,91
SCHNEIDER, FP	120,00	131,40	EUR	131,40		15.768,00
SHELL PLC, NA	184,00	26,57	EUR	26,57		4.888,88
SIEMENS, GY	273,00	129,36	EUR	129,36		35.315,28
SOCIETE GENERALE, FP	663,00	23,54	EUR	23,54		15.603,71
ST.GOBAIN, FP	287,00	45,75	EUR	45,75		13.128,82
TELE2 AB-B SHS, SS, SEK	406,00	85,48	SEK	7,69		3.120,44
TELEFONICA, SM	2.316,00	3,39	EUR	3,39		7.841,98
TELEPERFORMANCE, FP	30,00	224,10	EUR	224,10		6.723,00
THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	62,00	119,15	EUR	119,15		7.387,30
TOTALENERGIES SE, FP	619,00	58,99	EUR	58,99		36.514,81
UNICREDIT, IM	1.572,00	13,27	EUR	13,27		20.857,30
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	256,00	24,13	EUR	24,13		6.177,28
VINCI, FP	166,00	93,64	EUR	93,64		15.544,24
VONOVIA SE, GY	429,00	21,96	EUR	21,96		9.420,84
ZALANDO SA, GY	163,00	33,28	EUR	33,28		5.424,64
<b>1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.</b>					<b>0,00</b>	<b>49.166,02</b>
<b>1.3.4. Acções</b>					<b>0,00</b>	<b>49.166,02</b>
ASHTREAD GROUP, LN, GBP	90,00	47,20	GBP	53,22		4.789,55
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	47,00	121,12	CHF	123,00		5.781,23
GLENCORE XSTRATA, LN, GBP	951,00	5,52	GBP	6,23		5.923,04
NATWEST GROUP, LN, GBP	1.554,00	2,65	GBP	2,99		4.646,60
OCADO, LN, GBP	878,00	6,17	GBP	6,95		6.105,90
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	99,00	57,54	GBP	64,88		6.422,67
STELLANTIS NV, IM	1.161,00	13,35	EUR	13,35		15.497,03
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>						<b>1.809.555,39</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>						<b>1.809.555,39</b>
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	4.081,97	191,26	EUR	191,26		780.717,58
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	684,00	106,99	EUR	106,99		73.181,16
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	1.817,00	41,40	EUR	41,40		75.223,80
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM), ETF	648,00	81,94	EUR	81,94		53.097,12
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	5.123,80	151,48	EUR	151,48		776.153,53
X MSCI JAPAN EUR, FIM, ETF	2.081,00	24,60	EUR	24,60		51.182,20
<b>4. Imobiliário</b>						<b>134.076,64</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>						<b>134.076,64</b>
CAIXAGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	13.943,00	4,63	EUR	4,63		64.586,76
FUNDIMO (FII)	8.427,00	8,25	EUR	8,25		69.489,88
<b>5. Liquidez</b>						<b>98.609,47</b>
<b>5.1. À Vista</b>					<b>0,00</b>	<b>98.609,47</b>
Depósitos à Ordem					0,00	98.609,47
<b>9. Outros Activos</b>						<b>-2.647,79</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>						<b>-2.647,79</b>
Juros de D.O. a Regularizar						143,90
Impostos a Regularizar						5.667,51
Comissões						-8.459,20

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

4.858.473,05  
821.620,26  
5,91

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 Início	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%