

CAIXA PPR INVESTIMENTO

30 Junho 2019

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 30/06/2019, 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					18.165,45	7.023.412,87	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					18.151,28	5.856.212,79	83,4%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					143,44	106.604,44	1,5%
1.1.3. Obrigações Diversas					143,44	106.604,44	1,5%
REN FINANCE, 1.75%, 01/06/2023, CORP	100.000,00	106,46%	EUR	106,46%	143,44	106.604,44	1,5%
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.					17.673,11	4.785.549,62	68,1%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					17.261,46	1.842.349,01	26,2%
BOTS, CZ, 13/12/2019, GOVT	120.000,00	99,84%	EUR	99,84%	0,00	119.808,25	1,7%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	130.000,00	102,70%	EUR	102,70%	213,11	133.727,01	1,9%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	90.000,00	119,39%	EUR	119,39%	1.479,45	108.932,25	1,6%
CCTS, FRN, 15/12/2020, GOVT	125.000,00	100,44%	EUR	100,44%	30,06	125.577,56	1,8%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	112.000,00	107,99%	EUR	107,99%	490,96	121.442,00	1,7%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	88.000,00	105,00%	EUR	105,00%	1.072,88	93.471,12	1,3%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	166.000,00	121,26%	EUR	121,26%	4.812,86	206.104,46	2,9%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	173.000,00	101,63%	EUR	101,63%	0,00	175.814,71	2,5%
IRISH, 5.9%, 18/10/2019, GOVT	110.000,00	101,93%	EUR	101,93%	4.551,89	116.669,39	1,7%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	60.000,00	109,15%	EUR	109,15%	432,74	65.922,74	0,9%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	100.000,00	107,61%	EUR	107,61%	521,92	108.128,92	1,5%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	323.000,00	102,64%	EUR	102,64%	967,67	332.485,18	4,7%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	70.000,00	115,42%	EUR	115,42%	1.256,55	82.050,55	1,2%
SPGB, 4.3%, 31/10/2019, GOVT	50.000,00	101,57%	EUR	101,57%	1.431,37	52.214,87	0,7%
1.2.3. Obrigações Diversas					411,65	1.586.368,48	22,6%
BANCO SANTANDER SA, FRN, 04/03/2020, CORP	100.000,00	100,31%	EUR	100,31%	20,85	100.326,85	1,4%
CARREFOUR BANQUE, FRN, 20/04/2021, CORP, CALL	100.000,00	100,28%	EUR	100,28%	70,73	100.354,73	1,4%
CREDIT AGRICOLE LONDON, FRN, 17/01/2022, CORP	100.000,00	100,77%	EUR	100,77%	50,00	100.818,00	1,4%
DELTA SPARK 2008-1 A, FRN, 22/07/2023, MTG	34.056,37	99,83%	EUR	99,83%	1,02	34.000,52	0,5%
DEUTSCHE BANK AG, FRN, 07/12/2020, CORP	100.000,00	98,78%	EUR	98,78%	12,00	98.793,00	1,4%
DH EUROPE FINANCE SA, FRN, 30/06/2022, CORP	100.000,00	99,53%	EUR	99,53%	0,00	99.530,00	1,4%
FCA BANK, FRN, 17/06/2021, CORP	100.000,00	99,31%	EUR	99,31%	0,47	99.312,47	1,4%
GE CAPITAL, FRN, 17/05/2021, CORP	100.000,00	99,81%	EUR	99,81%	0,00	99.814,00	1,4%
ING BANK, FRN, 08/04/2022, CORP	100.000,00	100,48%	EUR	100,48%	21,00	100.505,00	1,4%
INTESA SANPAOLO, FRN, 15/06/2020, CORP	100.000,00	100,54%	EUR	100,54%	28,47	100.571,47	1,4%
KBC GROUP NV, FRN, 24/11/2022, CORP	100.000,00	100,44%	EUR	100,44%	25,23	100.465,23	1,4%
NATWEST MARKETS, FRN, 27/09/2021, CORP	100.000,00	100,50%	EUR	100,50%	6,17	100.503,17	1,4%
NIBC BANK NV, FRN, 30/07/2020, CORP	100.000,00	100,04%	EUR	100,04%	32,72	100.069,05	1,4%
NORDEA BANK ABP, FRN, 27/09/2021, CORP	100.000,00	100,71%	EUR	100,71%	1,72	100.709,72	1,4%
RENAULT CREDIT BANQUE, FRN, 14/03/2022, CORP	50.000,00	99,82%	EUR	99,82%	8,31	49.917,31	0,7%
SKY PLC, FRN, 01/04/2020, CORP	100.000,00	100,36%	EUR	100,36%	110,97	100.474,97	1,4%
VOLKSWAGEN BANK, FRN, 08/12/2021, CORP	100.000,00	100,18%	EUR	100,18%	21,99	100.202,99	1,4%
1.2.4. Acções						1.356.832,13	19,3%
3I GROUP Plc, LN, GBP	708,00	11,14	GBP	12,42		8.793,24	0,1%
ADIDAS, GY	87,00	271,50	EUR	271,50		23.620,50	0,3%
AENA SA, SM	48,00	174,30	EUR	174,30		8.366,40	0,1%
AIR LIQUIDE, FP	63,00	123,05	EUR	123,05		7.752,15	0,1%
AIRBUS GROUP, FP	258,00	124,68	EUR	124,68		32.167,44	0,5%
AKZO NOBEL, NA	222,00	82,64	EUR	82,64		18.346,08	0,3%
ALLIANZ, GY	131,00	212,00	EUR	212,00		27.772,00	0,4%
ANGLO AMERICAN, LN, GBP	449,00	22,45	GBP	25,03		11.240,65	0,2%
ASML HOLDING, NA	244,00	183,74	EUR	183,74		44.832,56	0,6%
ATLANTIA, IM	302,00	22,91	EUR	22,91		6.918,82	0,1%
AXA, FP	375,00	23,10	EUR	23,10		8.662,50	0,1%

Designação		Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
	BANCO SANTANDER, SM	11.994,00	4,08	EUR	4,08		48.941,52	0,7%
	BASF, GY	275,00	63,92	EUR	63,92		17.578,00	0,3%
	BAWAG GROUP AG, AT	501,00	36,86	EUR	36,86		18.466,86	0,3%
	BAYER, GY	556,00	60,94	EUR	60,94		33.882,64	0,5%
	BBVA, SM	3.228,00	4,92	EUR	4,92		15.872,08	0,2%
	BMW, GY	163,00	65,09	EUR	65,09		10.609,67	0,2%
	BNP PARIBAS, FP	209,00	41,77	EUR	41,77		8.728,89	0,1%
	CONTINENTAL, GY	48,00	128,22	EUR	128,22		6.154,56	0,1%
	COVESTRO AG, GY	279,00	44,71	EUR	44,71		12.474,09	0,2%
	CREDIT AGRICOLE, FP	2.006,00	10,55	EUR	10,55		21.153,27	0,3%
	CRH, ID	349,00	28,69	EUR	28,69		10.012,81	0,1%
	DAIMLER, GY	418,00	48,93	EUR	48,93		20.450,65	0,3%
	DANONE, FP	192,00	74,50	EUR	74,50		14.304,00	0,2%
	DEUTSCHE POST, GY	526,00	28,90	EUR	28,90		15.201,40	0,2%
	DEUTSCHE TELEKOM, GY	923,00	15,21	EUR	15,21		14.040,68	0,2%
	DSM, NA	199,00	108,70	EUR	108,70		21.631,30	0,3%
	E.ON, GY	928,00	9,55	EUR	9,55		8.863,33	0,1%
	ENEL, IM	3.079,00	6,14	EUR	6,14		18.905,06	0,3%
	ERSTE BANK AUSTRIA, AV	693,00	32,64	EUR	32,64		22.619,52	0,3%
	ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
	ESSILOR, FP	122,00	114,75	EUR	114,75		13.999,50	0,2%
	ESSITY AB, SS, SEK	369,00	285,40	SEK	27,02		9.969,67	0,1%
	EXOR NV, IM	191,00	61,60	EUR	61,60		11.765,60	0,2%
	FIAT CHRYSLER, IM	494,00	12,27	EUR	12,27		6.059,40	0,1%
	FRESENIUS, GY	236,00	47,68	EUR	47,68		11.252,48	0,2%
	HERMES, FP	13,00	634,20	EUR	634,20		8.244,60	0,1%
	IBERDROLA, SM	2.233,00	8,77	EUR	8,77		19.574,48	0,3%
	INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA, SM	538,00	26,45	EUR	26,45		14.230,10	0,2%
	INFORMA PLC, LN, GBP	1.029,00	8,35	GBP	9,31		9.583,57	0,1%
	ING Groep, NA	2.500,00	10,20	EUR	10,20		25.490,00	0,4%
	KERING, FP	35,00	520,10	EUR	520,10		18.203,50	0,3%
	KONE, FH	186,00	51,90	EUR	51,90		9.653,40	0,1%
	KPN, NA	3.135,00	2,70	EUR	2,70		8.464,50	0,1%
	L' OREAL, FP	123,00	250,50	EUR	250,50		30.811,50	0,4%
	LVMH, FP	130,00	374,30	EUR	374,30		48.659,00	0,7%
	MASMOVIL IBERCOM, SM	544,00	19,60	EUR	19,60		10.662,40	0,2%
	MEDIOBANCA, IM	1.743,00	9,07	EUR	9,07		15.802,04	0,2%
	MICHELIN, FP	74,00	111,55	EUR	111,55		8.254,70	0,1%
	NESTE OYJ, FH	661,00	29,84	EUR	29,84		19.724,24	0,3%
	NOKIA, FH	4.463,00	4,37	EUR	4,37		19.485,46	0,3%
	OCADO, LN, GBP	858,00	11,67	GBP	13,02		11.168,21	0,2%
	ORANGE, FP	1.856,00	13,87	EUR	13,87		25.733,44	0,4%
	PERNOD-RICARD, FP	212,00	162,05	EUR	162,05		34.354,60	0,5%
	PORSCHE, GY	111,00	57,14	EUR	57,14		6.342,54	0,1%
	PRUDENTIAL, LN, GBP	1.015,00	17,16	GBP	19,14		19.427,14	0,3%
	RECKITT BENCKISER, LN, GBP	134,00	62,14	GBP	69,31		9.287,56	0,1%
	RENAULT, FP	104,00	55,29	EUR	55,29		5.750,16	0,1%
	REPSOL, SM	1.010,00	13,79	EUR	13,79		13.922,85	0,2%
	SAFRAN, FP	171,00	128,85	EUR	128,85		22.033,35	0,3%
	SANOFI-SYNTHELABO, FP	410,00	75,91	EUR	75,91		31.123,10	0,4%
	SAP, GY	392,00	120,76	EUR	120,76		47.337,92	0,7%
	SCHNEIDER, FP	287,00	79,76	EUR	79,76		22.891,12	0,3%
	SIEMENS HEALTHINEERS, GY	268,00	37,11	EUR	37,11		9.945,48	0,1%
	SIEMENS, GY	398,00	104,60	EUR	104,60		41.630,80	0,6%
	ST.GOBAIN, FP	296,00	34,28	EUR	34,28		10.145,40	0,1%
	TELECOM ITALIA, IM	20.150,00	0,48	EUR	0,48		9.676,03	0,1%
	TELEFONICA, SM	1.095,00	7,22	EUR	7,22		7.907,00	0,1%
	THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	66,00	108,65	EUR	108,65		7.170,90	0,1%
	TOTAL FINA, FP	728,00	49,28	EUR	49,28		35.872,20	0,5%
	UNICREDIT, IM	465,00	10,83	EUR	10,83		5.034,09	0,1%
	UNILEVER, NA	1.135,00	53,56	EUR	53,56		60.790,60	0,9%
	VINCI, FP	306,00	90,06	EUR	90,06		27.558,36	0,4%
	VOLKSWAGEN PFD, GY	101,00	148,22	EUR	148,22		14.970,22	0,2%
	WIRECARD AG, GY	125,00	148,05	EUR	148,05		18.506,25	0,3%
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					334,73	964.058,73	13,7%
1.3.1.	Títulos De Dívida Pública					0,00	100.004,00	1,4%
	CHILE, 0.83%, 02/07/2031, GOVT, CALL	100.000,00	100,00%	EUR	100,00%	0,00	100.004,00	1,4%
1.3.3.	Obrigações Diversas					334,73	864.054,73	12,3%
	AT&T, FRN, 05/09/2023, CORP	100.000,00	101,04%	EUR	101,04%	39,60	101.074,60	1,4%
	BANK OF MONTREAL, FRN, 28/09/2021, CORP	100.000,00	100,67%	EUR	100,67%	1,31	100.675,31	1,4%
	BANK OF NOVA SCOTIA, FRN, 05/10/2022, CORP	100.000,00	100,93%	EUR	100,93%	70,08	101.000,08	1,4%
	BAT CAPITAL GROUP, FRN, 16/08/2021, CORP	100.000,00	99,84%	EUR	99,84%	24,15	99.868,15	1,4%
	CITIGROUP, FRN, 24/05/2021, CORP	100.000,00	101,14%	EUR	101,14%	54,78	101.192,78	1,4%
	GENERAL MILLS, FRN, 15/01/2020, CORP	100.000,00	100,25%	EUR	100,25%	89,83	100.343,83	1,4%
	GOLDMAN SACHS, FRN, 26/09/2023, CORP, CALL	60.000,00	99,60%	EUR	99,60%	2,31	59.762,31	0,9%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
MYLAN NV, FRN, 24/05/2020, CORP	100.000,00	99,73%	EUR	99,73%	19,95	99.746,95	1,4%
WELLS FARGO, FRN, 31/01/2022, CORP	100.000,00	100,36%	EUR	100,36%	32,72	100.390,72	1,4%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						238.577,87	3,4%
3.1. Fundos Harmonizados						238.577,87	3,4%
ALLIANZ EUROLAND EQY GROW - IT	8,00	2.568,49	EUR	2.568,49		20.547,92	0,3%
AMUNDI EUROLAND EQUITY, LUX	2.288,00	9,46	EUR	9,46		21.644,48	0,3%
INVESTEC GS EUROPEAN EQ-IA	1.335,00	28,97	EUR	28,97		38.674,95	0,6%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	740,00	139,18	EUR	139,18		102.993,20	1,5%
ISHARES MSCI EMERGING MARKET (FIM)	1.453,00	42,86	USD	37,66		54.717,32	0,8%
4. Imobiliário						55.166,87	0,8%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						55.166,87	0,8%
CAIXAGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	13.943,00	3,96	EUR	3,96		55.166,87	0,8%
5. Liquidez						881.262,10	12,5%
5.1. À Vista					0,00	581.247,93	8,3%
Depósitos à Ordem					0,00	581.247,93	8,3%
5.2. A Prazo					14,17	300.014,17	4,3%
Depósitos e Outros Equiparados					14,17	300.014,17	4,3%
9. Outros Activos						-7.806,76	-0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores						-7.806,76	-0,1%
Juros de D.O. a Regularizar						143,55	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	1.791,24	0,0%
Impostos a Regularizar						1.783,52	0,0%
Comissões						-11.525,07	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

7.029.465,38

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

1.040.446,00

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6,75620

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%;
- 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;
- 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	-5,22%
2009	9,71%	5,09%	3 Anos	-1,60%
2010	-1,76%	5,64%	5 Anos	-0,09%
2011	-3,11%	5,83%	Desde o Inicio	1,32%
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%		

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

Não se apresentam valores referentes ao ano de 2019, na medida em que o período em análise é inferior a doze meses.

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%