

CAIXA PPR INVESTIMENTO

31 Dezembro 2018

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 31/12/2018, 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					29.756,08	6.964.325,32	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					29.656,08	5.948.447,06	85,4%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					1.455,44	131.573,67	1,9%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					429,41	27.334,64	0,4%
PGB, 2.25%, 18/04/2034, GOVT	27.000,00	99,65%	EUR	99,65%	429,41	27.334,64	0,4%
1.1.3. Obrigações Diversas					1.026,03	104.239,03	1,5%
REN FINANCE, 1.75%, 01/06/2023, CORP	100.000,00	103,21%	EUR	103,21%	1.026,03	104.239,03	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.					27.828,24	4.761.513,09	68,4%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					27.378,79	2.051.231,67	29,5%
BKO, 0%, 15/03/2019, GOVT	37.000,00	100,10%	EUR	100,10%	0,00	37.036,63	0,5%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	215.000,00	98,46%	EUR	98,46%	366,21	212.063,81	3,0%
BTPS, 3.5%, 01/03/2030, GOVT	10.000,00	106,16%	EUR	106,16%	116,99	10.732,59	0,2%
BTPS, 4.5%, 01/05/2023, GOVT	150.000,00	112,00%	EUR	112,00%	1.128,08	169.122,08	2,4%
DBR, 0.5%, 15/02/2025, GOVT	68.000,00	104,06%	EUR	104,06%	298,08	71.055,48	1,0%
DBR, 0.5%, 15/02/2026, GOVT	42.000,00	103,92%	EUR	103,92%	184,11	43.830,51	0,6%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	115.000,00	103,32%	EUR	103,32%	218,97	119.040,42	1,7%
DBR, 1.5%, 15/05/2023, GOVT	156.000,00	108,29%	EUR	108,29%	1.480,93	170.414,89	2,4%
DBR, 1.75%, 15/02/2024, GOVT	78.000,00	110,45%	EUR	110,45%	1.196,71	87.344,59	1,3%
DBR, 3.25%, 04/01/2020, GOVT	120.000,00	103,99%	EUR	103,99%	3.867,95	128.652,35	1,8%
DBR, 4.75%, 04/07/2028, GOVT	55.000,00	142,96%	EUR	142,96%	1.295,51	79.924,61	1,1%
DBR, 5.5%, 04/01/2031, GOVT	20.000,00	160,70%	EUR	160,70%	1.090,96	33.231,36	0,5%
DBR, 6.25%, 04/01/2024, GOVT	90.000,00	132,91%	EUR	132,91%	5.578,77	125.193,27	1,8%
FRTR, 1.75%, 25/11/2024, GOVT	100.000,00	109,60%	EUR	109,60%	177,40	109.775,40	1,6%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	56.000,00	120,95%	EUR	120,95%	443,40	68.176,52	1,0%
NETHERLANDS, 5.5%, 15/01/2028, GOVT	40.000,00	146,70%	EUR	146,70%	2.115,62	60.797,22	0,9%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	40.000,00	103,33%	EUR	103,33%	60,00	41.392,00	0,6%
SPGB, 0,45%, 31/10/2022, GOVT	187.000,00	101,33%	EUR	101,33%	142,94	189.622,56	2,7%
SPGB, 4.6%, 30/07/2019, GOVT	170.000,00	102,89%	EUR	102,89%	3.320,82	178.228,72	2,6%
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	78.000,00	142,69%	EUR	142,69%	4.295,34	115.596,66	1,7%
1.2.3. Obrigações Diversas					449,45	1.508.810,55	21,7%
ALLERGAN FUNDINGS SCS, FRN, 15/11/2020, CORP	100.000,00	99,39%	EUR	99,39%	4,44	99.397,44	1,4%
AUTOROUTES PARIS, FRN, 31/03/2019, CORP	100.000,00	100,12%	EUR	100,12%	2,45	100.125,45	1,4%
BANCO SANTANDER SA, FRN, 04/03/2020, CORP	100.000,00	100,23%	EUR	100,23%	22,09	100.249,09	1,4%
CARREFOUR BANQUE, FRN, 20/04/2021, CORP, CALL	100.000,00	99,71%	EUR	99,71%	71,59	99.777,59	1,4%
COMMERZBANK AG, FRN, 04/12/2020, CORP	100.000,00	100,03%	EUR	100,03%	10,42	100.035,42	1,4%
DELTA SPARK 2008-1 A, FRN, 22/07/2023, MTG	38.239,35	99,18%	EUR	99,18%	1,56	37.927,35	0,5%
DEUTSCHE BANK AG, FRN, 15/04/2019, CORP	200.000,00	99,92%	EUR	99,92%	100,53	199.942,53	2,9%
DH EUROPE FINANCE SA, FRN, 30/06/2022, CORP	100.000,00	99,51%	EUR	99,51%	0,00	99.505,00	1,4%
INTESA SANPAOLO, FRN, 15/06/2020, CORP	100.000,00	99,86%	EUR	99,86%	30,79	99.886,79	1,4%
KBC GROUP NV, FRN, 24/11/2022, CORP	100.000,00	98,46%	EUR	98,46%	23,40	98.482,40	1,4%
NATWEST MARKETS, FRN, 27/09/2021, CORP	100.000,00	98,55%	EUR	98,55%	8,19	98.553,19	1,4%
NIBC BANK NV, FRN, 30/07/2020, CORP	100.000,00	100,03%	EUR	100,03%	31,85	100.064,85	1,4%
NORDEA BANK ABP, FRN, 27/09/2021, CORP	100.000,00	100,21%	EUR	100,21%	2,64	100.212,64	1,4%
NRW BANK, FRN, 26/01/2023, CORP	25.000,00	103,44%	EUR	103,44%	20,15	25.879,96	0,4%
RENAULT CREDIT BANQUE, FRN, 14/03/2022, CORP	50.000,00	96,95%	EUR	96,95%	8,95	48.484,45	0,7%
SKY PLC, FRN, 01/04/2020, CORP	100.000,00	100,18%	EUR	100,18%	110,40	100.286,40	1,4%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
1.2.4. Acções						1.201.470,87	17,3%
ABN AMRO GROUP NV, NA	542,00	20,54	EUR	20,54		11.132,68	0,2%
ACS, SM	290,00	33,83	EUR	33,83		9.810,70	0,1%
ADIDAS, GY	92,00	182,40	EUR	182,40		16.780,80	0,2%
AIR LIQUIDE, FP	283,00	108,45	EUR	108,45		30.691,35	0,4%
AIRBUS GROUP, FP	366,00	83,96	EUR	83,96		30.729,36	0,4%
AKZO NOBEL, NA	222,00	70,40	EUR	70,40		15.628,80	0,2%
ALLIANZ, GY	293,00	175,14	EUR	175,14		51.316,02	0,7%
AMADEUS, SA, SM	121,00	60,84	EUR	60,84		7.361,64	0,1%
ANGLO AMERICAN, LN, GBP	449,00	17,48	GBP	19,54		8.772,90	0,1%
ARCELOR MITTAL, NA	627,00	18,14	EUR	18,14		11.373,78	0,2%
ASML HOLDING, NA	275,00	137,16	EUR	137,16		37.719,00	0,5%
ASR NEDERLAND NV, NA	595,00	34,58	EUR	34,58		20.575,10	0,3%
BANCA INTESA, IM	6.628,00	1,94	EUR	1,94		12.856,99	0,2%
BANCO SANTANDER, SM	11.694,00	3,97	EUR	3,97		46.460,26	0,7%
BASF, GY	275,00	60,40	EUR	60,40		16.610,00	0,2%
BAYER, GY	503,00	60,56	EUR	60,56		30.461,68	0,4%
BMW, GY	134,00	70,70	EUR	70,70		9.473,80	0,1%
BNP PARIBAS, FP	128,00	39,48	EUR	39,48		5.052,80	0,1%
CAIXABANK SA, SM	3.871,00	3,16	EUR	3,16		12.247,84	0,2%
CRH, ID	349,00	23,10	EUR	23,10		8.061,90	0,1%
DAIMLER, GY	226,00	45,91	EUR	45,91		10.375,66	0,1%
DANONE, FP	192,00	61,51	EUR	61,51		11.809,92	0,2%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1.072,00	14,82	EUR	14,82		15.887,04	0,2%
DIRECT LINE INSURANCE, LN, GBP	5.382,00	3,19	GBP	3,56		19.174,80	0,3%
E.ON, GY	928,00	8,63	EUR	8,63		8.005,86	0,1%
ENEL, IM	3.079,00	5,04	EUR	5,04		15.530,48	0,2%
ENI SPA, IM	441,00	13,75	EUR	13,75		6.062,87	0,1%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	571,00	29,05	EUR	29,05		16.587,55	0,2%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSITY AB, SS, SEK	369,00	217,60	SEK	21,22		7.829,93	0,1%
FIAT CHRYSLER, IM	1.021,00	12,68	EUR	12,68		12.948,32	0,2%
FRESENIUS, GY	236,00	42,38	EUR	42,38		10.001,68	0,1%
IBERDROLA, SM	2.233,00	7,02	EUR	7,02		15.671,19	0,2%
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA, SM	538,00	22,35	EUR	22,35		12.024,30	0,2%
INFINEON, GY	373,00	17,37	EUR	17,37		6.477,15	0,1%
KBC GROUPE, BB	434,00	56,68	EUR	56,68		24.599,12	0,4%
KERING, FP	39,00	411,60	EUR	411,60		16.052,40	0,2%
L'OREAL, FP	123,00	201,20	EUR	201,20		24.747,60	0,4%
LUFTHANSA, GY	494,00	19,70	EUR	19,70		9.731,80	0,1%
LVMH, FP	101,00	258,20	EUR	258,20		26.078,20	0,4%
MASMOVIL IBERCOM, SM	815,00	19,50	EUR	19,50		15.892,50	0,2%
MONCLER, IM	678,00	28,93	EUR	28,93		19.614,54	0,3%
MTU AERO ENGINES AG, GY	57,00	158,40	EUR	158,40		9.028,80	0,1%
NOKIA, FH	5.980,00	5,03	EUR	5,03		30.079,40	0,4%
OCADO, LN, GBP	1.074,00	7,90	GBP	8,83		9.484,98	0,1%
ORANGE, FP	2.028,00	14,16	EUR	14,16		28.706,34	0,4%
PERNOD-RICARD, FP	212,00	143,30	EUR	143,30		30.379,60	0,4%
PRUDENTIAL, LN, GBP	333,00	14,02	GBP	15,67		5.219,12	0,1%
PSA PEUGEOT, FP	856,00	18,65	EUR	18,65		15.960,12	0,2%
RAIFFEISEN BANK, AV	566,00	22,20	EUR	22,20		12.565,20	0,2%
RANDSTAD HOLDING, NA	471,00	40,09	EUR	40,09		18.882,39	0,3%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	134,00	60,13	GBP	67,22		9.007,43	0,1%
RENAULT, FP	235,00	54,55	EUR	54,55		12.819,25	0,2%
REPSOL, SM	712,00	14,08	EUR	14,08		10.024,96	0,1%
SAFRAN, FP	401,00	105,40	EUR	105,40		42.265,40	0,6%
SANDVIK AB, SS, SEK	1.146,00	126,35	SEK	12,32		14.119,93	0,2%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	410,00	75,66	EUR	75,66		31.020,60	0,4%
SAP, GY	234,00	86,93	EUR	86,93		20.341,62	0,3%
SIEMENS HEALTHINEERS, GY	268,00	36,55	EUR	36,55		9.794,06	0,1%
SIEMENS, GY	186,00	97,38	EUR	97,38		18.112,68	0,3%
TELEFONICA, SM	3.477,00	7,34	EUR	7,34		25.517,70	0,4%
TOTAL FINA, FP	1.120,00	46,18	EUR	46,18		51.721,60	0,7%
UNICREDIT, IM	1.332,00	9,89	EUR	9,89		13.178,81	0,2%
UNILEVER, NA	1.135,00	47,42	EUR	47,42		53.821,70	0,8%
VINCI, FP	139,00	72,02	EUR	72,02		10.010,78	0,1%
VOLKSWAGEN PFD, GY	101,00	138,92	EUR	138,92		14.030,92	0,2%
VONOVIA SE, GY	3,00	39,59	EUR	39,59		118,77	0,0%
WIRECARD AG, GY	53,00	132,80	EUR	132,80		7.038,40	0,1%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					372,40	1.055.360,30	15,2%
1.3.3. Obrigações Diversas					372,40	1.055.360,30	15,2%
3M COMPANY, FRN, 15/05/2020, CORP	100.000,00	99,97%	EUR	99,97%	0,00	99.974,00	1,4%
AT&T, FRN, 05/09/2023, CORP	100.000,00	98,75%	EUR	98,75%	41,53	98.794,03	1,4%
BANK OF AMERICA, FRN, 07/02/2022, CORP, CALL	100.000,00	100,05%	EUR	100,05%	73,64	100.122,64	1,4%
BANK OF MONTREAL, FRN, 28/09/2021, CORP	100.000,00	100,42%	EUR	100,42%	2,12	100.420,12	1,4%
BANK OF NOVA SCOTIA, FRN, 05/10/2022, CORP	100.000,00	100,52%	EUR	100,52%	68,93	100.584,93	1,4%
BAT CAPITAL GROUP, FRN, 16/08/2021, CORP	100.000,00	97,90%	EUR	97,90%	23,51	97.918,51	1,4%
CITIGROUP, FRN, 24/05/2021, CORP	100.000,00	100,51%	EUR	100,51%	51,40	100.558,40	1,4%
GENERAL MILLS, FRN, 15/01/2020, CORP	100.000,00	100,39%	EUR	100,39%	89,27	100.479,27	1,4%
GOLDMAN SACHS, FRN, 26/09/2023, CORP, CALL	60.000,00	95,27%	EUR	95,27%	2,58	57.163,98	0,8%
MCDONALD'S CORP, FRN, 26/08/2019, CORP	100.000,00	100,00%	EUR	100,00%	0,00	99.997,00	1,4%
MYLAN NV, FRN, 24/05/2020, CORP	100.000,00	99,33%	EUR	99,33%	19,42	99.347,42	1,4%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						509.911,97	7,3%
3.1. Fundos Harmonizados						509.911,97	7,3%
ALLIANZ EUROLDO EQY GROW - IT	8,00	2.171,00	EUR	2.171,00		17.368,00	0,2%
HYPO DOW DJ EURO STOXX 50 ETF, FIM	4.558,00	29,96	EUR	29,96		136.534,89	2,0%
INVESTECS GS EUROPEAN EQ-IA	1.335,00	26,02	EUR	26,02		34.736,70	0,5%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	740,00	132,62	EUR	132,62		98.138,80	1,4%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM)	3.654,00	56,05	EUR	56,05		204.806,70	2,9%
PIONEER FUNDS - EUROLDO EQ - IEUR	2.288,00	8,01	EUR	8,01		18.326,88	0,3%
4. Imobiliário						53.755,84	0,8%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						53.755,84	0,8%
CAIXAGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	13.943,00	3,86	EUR	3,86		53.755,84	0,8%
5. Liquidez						463.694,24	6,7%
5.1. À Vista					0,00	163.594,24	2,3%
Depósitos à Ordem					0,00	163.594,24	2,3%
5.2. A Prazo					100,00	300.100,00	4,3%
Depósitos e Outros Equiparados					100,00	300.100,00	4,3%
9. Outros Activos						-11.483,79	-0,2%
9.1. Outros Devedores E Credores						-11.483,79	-0,2%
Juros de D.O. a Regularizar						143,55	0,0%
Impostos a Regularizar						272,89	0,0%
Comissões						-11.900,23	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

6.964.325,32

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

1.072.361,00

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6,49439

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 Início	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 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%