

CAIXA PPR INVESTIMENTO

31 outubro 2024

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					6.596,62	4.395.437,88	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					6.596,62	2.561.820,71	58,3%
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.					6.061,76	2.492.144,85	56,7%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					6.061,76	1.626.285,33	37,0%
AUSTRIA, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	15.000,00	58,63%	EUR	58,63%	69,66	8.864,61	0,2%
AUSTRIA, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	190.000,00	96,93%	EUR	96,93%	46,85	184.217,65	4,2%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	82.000,00	96,29%	EUR	96,29%	873,47	79.827,17	1,8%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	40.000,00	85,63%	EUR	85,63%	158,85	34.408,85	0,8%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	62.000,00	63,10%	EUR	63,10%	177,61	39.298,99	0,9%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	25.000,00	99,29%	EUR	99,29%	209,02	25.031,02	0,6%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	90.000,00	90,78%	EUR	90,78%	470,14	82.174,84	1,9%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	45.000,00	75,39%	EUR	75,39%	0,00	33.923,25	0,8%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	136.000,00	52,05%	EUR	52,05%	0,00	70.782,56	1,6%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	3.000,00	92,32%	EUR	92,32%	5,33	2.774,81	0,1%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	150.000,00	95,62%	EUR	95,62%	160,27	143.594,77	3,3%
DBR, CZ, 15/02/2030, GOVT	125.000,00	89,16%	EUR	89,16%	0,00	111.445,00	2,5%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	21.000,00	85,01%	EUR	85,01%	0,00	17.852,31	0,4%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	101.000,00	85,94%	EUR	85,94%	0,00	86.801,42	2,0%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	73.000,00	95,56%	EUR	95,56%	170,53	69.930,79	1,6%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	50.000,00	50,56%	EUR	50,56%	164,38	25.443,38	0,6%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	150.000,00	85,05%	EUR	85,05%	821,92	128.395,42	2,9%
FRTR, CZ, 25/11/2029, GOVT	151.000,00	87,23%	EUR	87,23%	0,00	131.712,77	3,0%
IRISH, 1% 15/05/2026, GOVT	30.000,00	98,00%	EUR	98,00%	139,73	29.540,93	0,7%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	20.000,00	48,43%	EUR	48,43%	0,00	9.685,80	0,2%
NETHER, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	2.000,00	94,39%	EUR	94,39%	4,48	1.892,22	0,0%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	55.000,00	112,57%	EUR	112,57%	1.639,86	63.551,16	1,4%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	50.000,00	85,52%	EUR	85,52%	0,00	42.760,50	1,0%
SPGB, 0.85%, 30/07/2037, GOVT	55.000,00	74,72%	EUR	74,72%	120,40	41.215,85	0,9%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	10.000,00	67,51%	EUR	67,51%	25,75	6.776,55	0,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	160.000,00	95,99%	EUR	95,99%	803,51	154.382,71	3,5%
1.2.4. Acções						865.859,52	19,7%
ADIDAS, GY	54,00	218,20	EUR	218,20		11.782,80	0,3%
ADYEN NV, NA	7,00	1.406,20	EUR	1.406,20		9.843,40	0,2%
AHOLD DELHAIZE, NA	191,00	30,30	EUR	30,30		5.787,30	0,1%
AIR LIQUIDE, FP	136,00	164,66	EUR	164,66		22.393,76	0,5%
AIRBUS GROUP, FP	157,00	140,16	EUR	140,16		22.005,12	0,5%
AMADEUS, SA, SM	160,00	66,56	EUR	66,56		10.649,60	0,2%
AMUNDI, FP	102,00	66,50	EUR	66,50		6.783,00	0,2%
ASML HOLDING, NA	94,00	621,20	EUR	621,20		58.392,80	1,3%
ASR NEDERLAND NV, NA	212,00	43,57	EUR	43,57		9.236,84	0,2%
AXA, FP	496,00	34,52	EUR	34,52		17.121,92	0,4%
BANCO SABADELL, SM	3.498,00	1,79	EUR	1,79		6.254,42	0,1%
BANCO SANTANDER, SM	3.814,00	4,49	EUR	4,49		17.130,58	0,4%
BAYER, GY	222,00	24,83	EUR	24,83		5.512,26	0,1%
BNP PARIBAS, FP	266,00	62,75	EUR	62,75		16.691,50	0,4%
CAIXABANK SA, SM	2.447,00	5,59	EUR	5,59		13.673,84	0,3%
CAP GEMINI, FP	67,00	159,20	EUR	159,20		10.666,40	0,2%
CELLNEX TELECOM, SM	220,00	33,65	EUR	33,65		7.403,00	0,2%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	34,00	125,30	CHF	133,13		4.526,35	0,1%
COMMERZBANK, GY	490,00	16,32	EUR	16,32		7.994,35	0,2%
CRH, LN, GBP	124,00	73,94	GBP	88,28		10.947,14	0,2%
DANONE, FP	89,00	65,70	EUR	65,70		5.847,30	0,1%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	825,00	27,83	EUR	27,83		22.959,75	0,5%
DSM-FIRMENICH AG, NA	75,00	109,10	EUR	109,10		8.182,50	0,2%
ENEL, IM	5.368,00	6,97	EUR	6,97		37.414,96	0,9%
ENI SPA, IM	651,00	14,01	EUR	14,01		9.120,51	0,2%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	143,00	51,36	EUR	51,36		7.344,48	0,2%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	50,00	215,30	EUR	215,30		10.765,00	0,2%
ESSITY AB, SS, SEK	181,00	299,70	SEK	25,77		4.663,97	0,1%
FERRARI NV, IM	32,00	439,80	EUR	439,80		14.073,60	0,3%
FERROVIAL SE, SM	146,00	36,86	EUR	36,86		5.381,56	0,1%
FINECOBANK SPA, IM	738,00	14,67	EUR	14,67		10.826,46	0,2%
HEIDELBERCEMENT, GY	40,00	101,20	EUR	101,20		4.048,00	0,1%
HERMES, FP	12,00	2.073,00	EUR	2.073,00		24.876,00	0,6%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	281,00	52,28	EUR	52,28		14.690,68	0,3%
INFINEON, GY	110,00	29,04	EUR	29,04		3.194,40	0,1%
ING Groep, NA	1.022,00	15,67	EUR	15,67		16.018,83	0,4%
L' OREAL, FP	46,00	344,25	EUR	344,25		15.835,50	0,4%
LVMH, FP	66,00	609,80	EUR	609,80		40.246,80	0,9%

	MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	174,00	55,87	EUR	55,87		9.721,38	0,2%
	MERCK KGAA, GY	43,00	152,00	EUR	152,00		6.536,00	0,1%
	MICHELIN, FP	127,00	31,04	EUR	31,04		3.942,08	0,1%
	MUNCHENER RUCK, GY	35,00	470,00	EUR	470,00		16.450,00	0,4%
	PERNOD-RICARD, FP	61,00	114,25	EUR	114,25		6.969,25	0,2%
	PROSUS NV, NA	242,00	38,74	EUR	38,74		9.375,08	0,2%
	PUIG BRANDS SA-B, SM	290,00	21,18	EUR	21,18		6.142,20	0,1%
	RWE, GY	290,00	29,79	EUR	29,79		8.639,10	0,2%
	SAFRAN, FP	36,00	207,80	EUR	207,80		7.480,80	0,2%
	SANOFI-SYNTHELABO, FP	230,00	97,11	EUR	97,11		22.335,30	0,5%
	SAP, GY	160,00	214,10	EUR	214,10		34.256,00	0,8%
	SCHNEIDER, FP	136,00	237,20	EUR	237,20		32.259,20	0,7%
	SIEMENS, GY	191,00	178,12	EUR	178,12		34.020,92	0,8%
	SOCIETE GENERALE, FP	345,00	26,39	EUR	26,39		9.102,83	0,2%
	SPIE SA, FP	131,00	33,16	EUR	33,16		4.343,96	0,1%
	ST.GOBAIN, FP	127,00	82,98	EUR	82,98		10.538,46	0,2%
	STELLANTIS NV, IM	633,00	12,60	EUR	12,60		7.973,27	0,2%
	STMICROELECTRONICS, FP	248,00	25,02	EUR	25,02		6.203,72	0,1%
	THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	43,00	148,10	EUR	148,10		6.368,30	0,1%
	TOTALENERGIES SE, FP	469,00	57,39	EUR	57,39		26.915,91	0,6%
	UNICREDIT, IM	537,00	40,68	EUR	40,68		21.845,16	0,5%
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	299,00	23,02	EUR	23,02		6.882,98	0,2%
	VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	402,00	29,17	EUR	29,17		11.726,34	0,3%
	VINCI, FP	139,00	102,65	EUR	102,65		14.268,35	0,3%
	VONOVIA SE, GY	375,00	30,07	EUR	30,07		11.276,25	0,3%
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					534,86	69.675,86	1,6%
1.3.3.	Obrigações Diversas					534,86	55.588,21	1,3%
	BGB, 2.25%, 22/06/2057, GOVT	30.000,00	75,92%	EUR	75,92%	244,11	23.018,61	0,5%
	BGB, 2.75%, 22/04/2039, GOVT	10.000,00	94,86%	EUR	94,86%	145,41	9.631,01	0,2%
	BTPS, 3.45%, 01/03/2048, GOVT	25.000,00	91,17%	EUR	91,17%	145,34	22.938,59	0,5%
1.3.4.	Acções					0,00	14.087,65	0,3%
	ASHTREAD GROUP, LN, GBP	64,00	57,88	GBP	69,11		4.422,91	0,1%
	OCADO, LN, GBP	441,00	3,48	GBP	4,15		1.831,33	0,0%
	RECKITT BENCKISER, LN, GBP	69,00	46,84	GBP	55,93		3.858,92	0,1%
	SHELL PLC, NA	129,00	30,81	EUR	30,81		3.974,49	0,1%
2.	Valores Não Cotados					0,00	716.697,56	16,3%
2.2.	Valores Mobiliários Estrangeiros					0,00	716.697,56	16,3%
2.2.3.	Obrigações Diversas					0,00	716.697,56	16,3%
	VONTOBEL-EUR CRP BOND-GE (FIM)	6.428,93	111,48%	EUR	111,48%	0,00	716.697,56	16,3%
3.	Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						989.401,33	22,5%
3.1.	Fundos Harmonizados						989.401,33	22,5%
	BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	3.294,71	217,62	EUR	217,62		716.994,79	16,3%
	ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	2.197,00	111,42	EUR	111,42		244.789,74	5,6%
	ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	555,00	49,76	EUR	49,76		27.616,80	0,6%
4.	Imobiliário						73.313,21	1,7%
4.2.	Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						73.313,21	1,7%
	FUNDIMO (FII)	8.427,00	8,70	EUR	8,70		73.313,21	1,7%
5.	Liquidez						51.549,41	1,2%
5.1.	À Vista					0,00	51.549,41	1,2%
	Depósitos à Ordem					0,00	51.549,41	1,2%
9.	Outros Activos						2.655,66	0,1%
9.1.	Outros Devedores E Credores						2.655,66	0,1%
	Juros de D.O. a Regularizar						467,44	0,0%
	Transacções a Liquidar					0,00	626,21	0,0%
	Impostos a Regularizar						9.112,77	0,2%
	Comissões						-7.550,76	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

4.395.437,88

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

674.370,71

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6,52

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;

- 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
2008	-14,84%	4,49%
2009	9,71%	5,09%
2010	-1,76%	5,64%
2011	-3,11%	5,83%
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%
2023	8,39%	5,98%

	Rend. Anualizada
1 Ano	8,39%
3 Anos	-2,33%
5 Anos	-0,26%
Desde o Início	0,99%

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%