

CAIXA PPR INVESTIMENTO

31 dezembro 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					8.394,26	4.360.169,23	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					8.394,26	2.592.890,45	59,5%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					0,00	2.515,32	0,1%
1.1.4. Acções					0,00	2.515,32	0,1%
JERÓNIMO MARTINS, PL	137,00	18,36	EUR	18,36		2.515,32	0,1%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					8.394,26	2.558.785,03	58,7%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					8.394,26	1.657.438,52	38,0%
AUSTRIA, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	47.000,00	73,73%	EUR	73,73%	23,50	34.675,19	0,8%
AUSTRIA, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	9.000,00	59,70%	EUR	59,70%	53,08	5.426,35	0,1%
AUSTRIA, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	58.000,00	97,52%	EUR	97,52%	87,00	56.650,34	1,3%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	21.000,00	97,04%	EUR	97,04%	307,92	20.685,90	0,5%
AUSTRIA, 3.15%, 20/06/2044, GOVT	13.000,00	101,38%	EUR	101,38%	218,77	13.397,65	0,3%
BGB, 0.8%, 22/06/2027, GOVT	78.000,00	96,58%	EUR	96,58%	329,95	75.659,23	1,7%
BGB, 2.25%, 22/06/2057, GOVT	10.000,00	75,06%	EUR	75,06%	118,97	7.624,67	0,2%
BGB, 2.75%, 22/04/2039, GOVT	45.000,00	94,73%	EUR	94,73%	861,16	43.489,66	1,0%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	82.000,00	86,71%	EUR	86,71%	66,34	71.171,00	1,6%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	72.000,00	64,00%	EUR	64,00%	412,51	46.491,79	1,1%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	35.000,00	91,90%	EUR	91,90%	365,66	32.529,96	0,7%
BTPS, 3.45%, 01/03/2048, GOVT	64.000,00	92,21%	EUR	92,21%	744,13	59.757,89	1,4%
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	34.000,00	78,14%	EUR	78,14%	0,00	26.566,92	0,6%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	141.000,00	75,82%	EUR	75,82%	0,00	106.911,84	2,5%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	139.000,00	96,34%	EUR	96,34%	264,67	134.171,71	3,1%
DBR, CZ, 15/02/2030, GOVT	16.000,00	89,98%	EUR	89,98%	0,00	14.396,96	0,3%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	25.000,00	85,75%	EUR	85,75%	0,00	21.437,75	0,5%
DBR, CZ, 15/08/2031, GOVT	74.000,00	86,93%	EUR	86,93%	0,00	64.325,24	1,5%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	9.000,00	86,48%	EUR	86,48%	0,00	7.782,75	0,2%
EU, 0%, 06/07/2026, GOVT	30.000,00	96,74%	EUR	96,74%	0,00	29.021,10	0,7%
EUROPEAN UNION, CZ, 04/07/2035, GOVT	11.000,00	73,60%	EUR	73,60%	0,00	8.096,44	0,2%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	167.000,00	96,31%	EUR	96,31%	42,32	160.876,68	3,7%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	75.000,00	49,58%	EUR	49,58%	340,58	37.522,58	0,9%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	147.000,00	84,80%	EUR	84,80%	1.112,57	125.774,45	2,9%
IRISH, 1% 15/05/2026, GOVT	17.000,00	98,49%	EUR	98,49%	107,59	16.851,23	0,4%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	31.000,00	94,13%	EUR	94,13%	331,36	29.511,04	0,7%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	17.000,00	49,55%	EUR	49,55%	0,00	8.424,18	0,2%
NETHER, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	91.000,00	95,09%	EUR	95,09%	317,88	86.850,69	2,0%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	20.000,00	113,39%	EUR	113,39%	721,31	23.399,31	0,5%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	98.000,00	86,26%	EUR	86,26%	83,23	84.618,03	1,9%
SPGB, 0.85%, 30/07/2037, GOVT	61.000,00	75,23%	EUR	75,23%	220,19	46.109,88	1,1%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	46.000,00	67,97%	EUR	67,97%	195,34	31.460,16	0,7%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	129.000,00	96,67%	EUR	96,67%	1.068,23	125.769,95	2,9%
1.2.4. Acções						901.346,51	20,7%
ADIDAS, GY	41,00	235,60	EUR	235,60		9.659,60	0,2%
ADYEN NV, NA	10,00	1.434,00	EUR	1.434,00		14.340,00	0,3%
AHOLD DELHAIZE, NA	206,00	31,48	EUR	31,48		6.484,88	0,1%
AIR LIQUIDE, FP	112,00	156,72	EUR	156,72		17.552,64	0,4%
AIRBUS GROUP, FP	115,00	154,78	EUR	154,78		17.799,70	0,4%
AMUNDI, FP	156,00	64,20	EUR	64,20		10.015,20	0,2%
ANHEUSER-BUSCH INBEV, BB	152,00	48,25	EUR	48,25		7.334,00	0,2%
ARGENX SE, BB	17,00	599,80	EUR	599,80		10.196,60	0,2%
ASM INTERNATIONAL, NA	36,00	558,80	EUR	558,80		20.116,80	0,5%
ASML HOLDING, NA	106,00	678,70	EUR	678,70		71.942,20	1,6%
ASR NEDERLAND NV, NA	180,00	45,78	EUR	45,78		8.240,40	0,2%
AXA, FP	359,00	34,32	EUR	34,32		12.320,88	0,3%
BANCO SABADELL, SM	3.702,00	1,88	EUR	1,88		6.941,25	0,2%
BAYER, GY	213,00	19,30	EUR	19,30		4.110,90	0,1%
BNP PARIBAS, FP	242,00	59,21	EUR	59,21		14.328,82	0,3%
BPER BANCA SPA, IM	1.593,00	6,00	EUR	6,00		9.561,19	0,2%
CAIXABANK SA, SM	2.321,00	5,21	EUR	5,21		12.092,41	0,3%
CAP GEMINI, FP	86,00	158,00	EUR	158,00		13.588,00	0,3%
CELLNEX TELECOM, SM	204,00	30,51	EUR	30,51		6.224,04	0,1%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	19,00	137,90	CHF	146,52		2.783,79	0,1%
COMMERZBANK, GY	560,00	15,67	EUR	15,67		8.772,40	0,2%
CRH, LN, GBP	121,00	74,14	GBP	89,41		10.819,05	0,2%
DANONE, FP	133,00	64,84	EUR	64,84		8.623,72	0,2%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	648,00	28,81	EUR	28,81		18.668,88	0,4%
ENEL, IM	4.884,00	6,89	EUR	6,89		33.626,34	0,8%
ENI SPA, IM	451,00	13,00	EUR	13,00		5.863,00	0,1%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	171,00	59,34	EUR	59,34		10.147,14	0,2%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	61,00	234,70	EUR	234,70		14.316,70	0,3%
ESSITY AB, SS, SEK	118,00	295,20	SEK	25,76		3.039,85	0,1%
FERRARI NV, IM	28,00	409,00	EUR	409,00		11.452,00	0,3%
FERROVIAL SE, SM	174,00	40,40	EUR	40,40		7.029,60	0,2%
FINECOBANK SPA, IM	832,00	16,73	EUR	16,73		13.919,36	0,3%
HEIDELBERCEMENT, GY	27,00	119,15	EUR	119,15		3.217,05	0,1%
HERMES, FP	6,00	2.321,00	EUR	2.321,00		13.926,00	0,3%
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA, SM	230,00	50,00	EUR	50,00		11.500,00	0,3%
ING Groep, NA	1.133,00	15,13	EUR	15,13		17.142,29	0,4%
L' OREAL, FP	38,00	341,75	EUR	341,75		12.986,50	0,3%
LVMH, FP	44,00	635,50	EUR	635,50		27.962,00	0,6%

	MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	142,00	53,59	EUR	53,59		7.609,78	0,2%
	MERCK KGAA, GY	49,00	139,10	EUR	139,10		6.815,90	0,2%
	MUNCHENER RUCK, GY	35,00	486,90	EUR	486,90		17.041,50	0,4%
	NOVO NORDISK A/S, DK, DKK	53,00	620,30	DKK	83,17		4.408,26	0,1%
	PROSUS NV, NA	264,00	38,35	EUR	38,35		10.124,40	0,2%
	PUIG BRANDS SA-B, SM	220,00	17,81	EUR	17,81		3.918,20	0,1%
	RHEINMETALL AG, GY	15,00	616,00	EUR	616,00		9.240,00	0,2%
	RWE, GY	399,00	28,59	EUR	28,59		11.407,41	0,3%
	SAFRAN, FP	73,00	212,00	EUR	212,00		15.476,00	0,4%
	SANOFI-SYNTHELABO, FP	381,00	93,58	EUR	93,58		35.653,98	0,8%
	SAP, GY	111,00	236,15	EUR	236,15		26.212,65	0,6%
	SCHNEIDER, FP	106,00	240,90	EUR	240,90		25.535,40	0,6%
	SIEMENS ENERGY AG, GY	210,00	50,16	EUR	50,16		10.533,60	0,2%
	SIEMENS, GY	144,00	188,78	EUR	188,78		27.184,32	0,6%
	SOCIETE GENERALE, FP	378,00	27,16	EUR	27,16		10.264,59	0,2%
	SPIE SA, FP	153,00	29,88	EUR	29,88		4.571,64	0,1%
	ST.GOBAIN, FP	130,00	85,70	EUR	85,70		11.141,00	0,3%
	STELLANTIS NV, IM	457,00	12,53	EUR	12,53		5.726,21	0,1%
	TERNA, IM	1.187,00	7,60	EUR	7,60		9.021,20	0,2%
	TOTALENERGIES SE, FP	335,00	53,35	EUR	53,35		17.872,25	0,4%
	UCB, BB	45,00	192,15	EUR	192,15		8.646,75	0,2%
	UNICREDIT, IM	621,00	38,30	EUR	38,30		23.784,30	0,5%
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	267,00	24,71	EUR	24,71		6.597,57	0,2%
	VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	415,00	27,11	EUR	27,11		11.250,65	0,3%
	VINCI, FP	123,00	99,72	EUR	99,72		12.265,56	0,3%
	VONOVIA SE, GY	528,00	29,41	EUR	29,41		15.528,48	0,4%
	X MSCI JAPAN EUR, FIM, ETF	1.136,00	39,50	EUR	39,50		44.869,73	1,0%
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	31.590,10	0,7%
1.3.4.	Acções					0,00	31.590,10	0,7%
	COMPASS GROUP PLC, LN, GBP	129,00	26,59	GBP	32,07		4.136,75	0,1%
	INT CONSOLIDATED AIRLINE, GB	1.270,00	3,66	EUR	3,66		4.644,39	0,1%
	JUST GROUP PLC, LN, GBP	5.203,00	1,62	GBP	1,95		10.165,30	0,2%
	OCADO, LN, GBP	409,00	3,02	GBP	3,65		1.491,12	0,0%
	RECKITT BENCKISER, LN, GBP	70,00	48,32	GBP	58,27		4.079,21	0,1%
	RELX PLC, NA	101,00	43,72	EUR	43,72		4.415,72	0,1%
	SHELL PLC, LN, GBP	89,00	24,76	GBP	29,86		2.657,61	0,1%
2.	Valores Não Cotados					0,00	0,00	0,0%
2.1.	Valores Mobiliários Nacionais					0,00	0,00	0,0%
2.1.4.	Acções					0,00	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%
3.	Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.634.303,61	37,5%
3.1.	Fundos Harmonizados						1.634.303,61	37,5%
	BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	3.209,44	220,23	EUR	220,23		706.814,09	16,2%
	ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	1.765,00	112,39	EUR	112,39		198.359,53	4,5%
	ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	442,00	50,28	EUR	50,28		22.223,76	0,5%
	VONTOBEL-EUR CRP BOND-GE (FIM)	6.277,47	112,61	EUR	112,61		706.906,23	16,2%
4.	Imobiliário						72.944,95	1,7%
4.2.	Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						72.944,95	1,7%
	FUNDIMO (FII)	8.427,00	8,66	EUR	8,66		72.944,95	1,7%
5.	Liquidez						58.247,18	1,3%
5.1.	À Vista					0,00	58.247,18	1,3%
	Depósitos à Ordem					0,00	58.247,18	1,3%
9.	Outros Activos						1.783,04	0,0%
9.1.	Outros Devedores E Credores						1.783,04	0,0%
	Juros de D.O. a Regularizar						109,34	0,0%
	Impostos a Regularizar						9.129,74	0,2%
	Comissões						-7.456,04	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

4.360.169,23

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

663.969,70

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6,57

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
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%
2024	2,46%	2,57%

	Rend. Anualizada
1 Ano	2,46%
3 Anos	-2,36%
5 Anos	-0,70%
Desde o Início	1,05%

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%