

CAIXA PPR INVESTIMENTO

30 junho 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					8.090,22	4.456.768,25	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					8.090,22	2.603.764,27	58,4%
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.					8.090,22	2.590.441,50	58,1%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					8.090,22	1.714.429,66	38,5%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	167.000,00	94,57%	EUR	94,57%	428,25	158.351,80	3,6%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	42.000,00	58,36%	EUR	58,36%	236,71	24.746,65	0,6%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	60.000,00	86,02%	EUR	86,02%	616,63	52.228,03	1,2%
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	65.000,00	76,14%	EUR	76,14%	0,00	49.489,05	1,1%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	56.000,00	73,93%	EUR	73,93%	0,00	41.400,80	0,9%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	159.000,00	50,63%	EUR	50,63%	0,00	80.493,75	1,8%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	3.000,00	90,62%	EUR	90,62%	2,81	2.721,47	0,1%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	218.000,00	93,95%	EUR	93,95%	956,98	205.757,08	4,6%
DBR, CZ, 15/02/2030, GOVT	150.000,00	87,49%	EUR	87,49%	0,00	131.235,00	2,9%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	53.000,00	83,45%	EUR	83,45%	0,00	44.226,91	1,0%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	101.000,00	83,40%	EUR	83,40%	0,00	84.231,98	1,9%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	73.000,00	93,55%	EUR	93,55%	109,20	68.397,05	1,5%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	50.000,00	48,84%	EUR	48,84%	38,01	24.456,51	0,5%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	150.000,00	83,24%	EUR	83,24%	190,07	125.051,57	2,8%
FRTR, CZ, 25/11/2029, GOVT	151.000,00	85,23%	EUR	85,23%	0,00	128.689,75	2,9%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	30.000,00	46,50%	EUR	46,50%	0,00	13.950,90	0,3%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	80.000,00	110,84%	EUR	110,84%	1.377,05	90.051,45	2,0%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	2.000,00	92,66%	EUR	92,66%	14,43	1.867,69	0,0%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	14.000,00	96,29%	EUR	96,29%	0,00	13.480,74	0,3%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	15.000,00	55,95%	EUR	55,95%	31,75	8.424,85	0,2%
RAGB, 0.75%, 20/10/2026, GOVT	215.000,00	95,07%	EUR	95,07%	1.123,46	205.519,66	4,6%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	10.000,00	64,12%	EUR	64,12%	92,08	6.504,18	0,1%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	160.000,00	93,93%	EUR	93,93%	2.872,79	153.152,79	3,4%
1.2.4. Acções						876.011,84	19,7%
ADIDAS, GY	58,00	222,90	EUR	222,90		12.928,20	0,3%
ADYEN NV, NA	7,00	1.113,20	EUR	1.113,20		7.792,40	0,2%
AHOLD DELHAIZE, NA	191,00	27,59	EUR	27,59		5.269,69	0,1%
AIR LIQUIDE, FP	136,00	161,26	EUR	161,26		21.931,36	0,5%
AIRBUS GROUP, FP	157,00	128,26	EUR	128,26		20.136,82	0,5%
AMADEUS, SA, SM	160,00	61,98	EUR	61,98		9.916,80	0,2%
AMUNDI, FP	102,00	60,25	EUR	60,25		6.145,50	0,1%
ASML HOLDING, NA	94,00	964,20	EUR	964,20		90.634,80	2,0%
ASR NEDERLAND NV, NA	212,00	44,48	EUR	44,48		9.429,76	0,2%
AXA, FP	526,00	30,56	EUR	30,56		16.074,56	0,4%
BANCO SABADELL, SM	3.498,00	1,80	EUR	1,80		6.296,40	0,1%
BANCO SANTANDER, SM	4.047,00	4,33	EUR	4,33		17.525,53	0,4%
BAYER, GY	222,00	26,42	EUR	26,42		5.864,13	0,1%
BMW, GY	69,00	88,36	EUR	88,36		6.096,84	0,1%
BNP PARIBAS, FP	282,00	59,53	EUR	59,53		16.787,46	0,4%
CAIXABANK SA, SM	2.447,00	4,94	EUR	4,94		12.093,07	0,3%
CAP GEMINI, FP	67,00	185,65	EUR	185,65		12.438,55	0,3%
CELLNEX TELECOM, SM	220,00	30,37	EUR	30,37		6.681,40	0,1%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	34,00	140,20	CHF	145,53		4.947,89	0,1%
COMMERZBANK, GY	490,00	14,13	EUR	14,13		6.921,25	0,2%
CRH, LN, GBP	124,00	58,94	GBP	69,64		8.635,08	0,2%
DANONE, FP	89,00	57,08	EUR	57,08		5.080,12	0,1%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	825,00	23,48	EUR	23,48		19.371,00	0,4%
DSM-FIRMENICH AG, NA	75,00	105,55	EUR	105,55		7.916,25	0,2%
ENEL, IM	3.601,00	6,49	EUR	6,49		23.384,89	0,5%
ENI SPA, IM	651,00	14,35	EUR	14,35		9.341,85	0,2%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	143,00	44,25	EUR	44,25		6.327,75	0,1%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	13,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	54,00	201,20	EUR	201,20		10.864,80	0,2%
ESSITY AB, SS, SEK	181,00	270,90	SEK	23,85		4.316,47	0,1%
FERRARI NV, IM	31,00	380,70	EUR	380,70		11.801,70	0,3%
FERROVIAL SE, SM	146,00	36,18	EUR	36,18		5.282,28	0,1%
FINECOBANK SPA, IM	738,00	13,91	EUR	13,91		10.265,58	0,2%
HEIDELBERCEMENT, GY	40,00	96,44	EUR	96,44		3.857,60	0,1%
HERMES, FP	13,00	2.139,00	EUR	2.139,00		27.807,00	0,6%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	306,00	46,35	EUR	46,35		14.183,10	0,3%
INFINEON, GY	110,00	34,36	EUR	34,36		3.779,60	0,1%
ING Groep, NA	1.084,00	15,96	EUR	15,96		17.302,81	0,4%
L' OREAL, FP	46,00	410,05	EUR	410,05		18.862,30	0,4%
LVMH, FP	63,00	713,50	EUR	713,50		44.950,50	1,0%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	189,00	64,43	EUR	64,43		12.177,27	0,3%
MERCK KGAA, GY	43,00	154,90	EUR	154,90		6.660,70	0,1%
MICHELIN, FP	127,00	36,10	EUR	36,10		4.584,70	0,1%
MUNCHENER RUCK, GY	37,00	466,80	EUR	466,80		17.271,60	0,4%
NESTE OYJ, FH	117,00	16,54	EUR	16,54		1.935,18	0,0%
PERNOD-RICARD, FP	61,00	126,65	EUR	126,65		7.725,65	0,2%
PROSUS NV, NA	242,00	33,26	EUR	33,26		8.048,92	0,2%
PUIG BRANDS SA-B, SM	290,00	26,10	EUR	26,10		7.569,00	0,2%
RWE, GY	195,00	32,02	EUR	32,02		6.243,90	0,1%
SAFRAN, FP	36,00	197,35	EUR	197,35		7.104,60	0,2%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	230,00	89,94	EUR	89,94		20.686,20	0,5%
SAP, GY	160,00	189,82	EUR	189,82		30.371,20	0,7%
SCHNEIDER, FP	136,00	224,30	EUR	224,30		30.504,80	0,7%
SIEMENS, GY	191,00	174,12	EUR	174,12		33.256,92	0,7%
SOCIETE GENERALE, FP	345,00	21,92	EUR	21,92		7.562,40	0,2%
SPIE SA, FP	131,00	33,76	EUR	33,76		4.422,56	0,1%
ST.GOBAIN, FP	127,00	72,62	EUR	72,62		9.222,74	0,2%
STELLANTIS NV, IM	633,00	18,47	EUR	18,47		11.691,51	0,3%
STMICROELECTRONICS, FP	248,00	36,87	EUR	36,87		9.142,52	0,2%
THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	43,00	149,50	EUR	149,50		6.428,50	0,1%
TOTALENERGIES SE, FP	433,00	62,33	EUR	62,33		26.988,89	0,6%
UNICREDIT, IM	569,00	34,61	EUR	34,61		19.690,25	0,4%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	299,00	27,78	EUR	27,78		8.306,22	0,2%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	270,00	27,91	EUR	27,91		7.535,70	0,2%
VINCI, FP	139,00	98,38	EUR	98,38		13.674,82	0,3%
VONOVIA SE, GY	300,00	26,54	EUR	26,54		7.962,00	0,2%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	13.322,77	0,3%
1.3.4. Acções					0,00	13.322,77	0,3%
ASHTeAD GROUP, LN, GBP	64,00	52,82	GBP	62,41		3.994,05	0,1%
OCADO, LN, GBP	441,00	2,89	GBP	3,41		1.504,77	0,0%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	69,00	42,82	GBP	50,59		3.490,84	0,1%
SHELL PLC, NA	129,00	33,59	EUR	33,59		4.333,11	0,1%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.700.270,34	38,2%
3.1. Fundos Harmonizados						1.700.270,34	38,2%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	3.452,10	210,82	EUR	210,82		727.770,67	16,3%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	684,00	109,45	EUR	109,45		74.863,80	1,7%
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	555,00	50,56	EUR	50,56		28.060,80	0,6%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM), ETF	224,00	115,60	EUR	115,60		25.894,40	0,6%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	4.399,50	165,67	EUR	165,67		728.865,83	16,4%
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1.241,00	92,52	EUR	92,52		114.814,84	2,6%
4. Imobiliário						72.044,95	1,6%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						72.044,95	1,6%
FUNDIMO (FII)	8.427,00	8,55	EUR	8,55		72.044,95	1,6%
5. Liquidez						78.473,87	1,8%
5.1. À Vista					0,00	78.473,87	1,8%
Depósitos à Ordem					0,00	78.473,87	1,8%
9. Outros Activos						2.214,82	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores						2.214,82	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						268,83	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	290,76	0,0%
Impostos a Regularizar						9.017,42	0,2%
Comissões						-7.362,19	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

4.456.768,25

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

692.512,46

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

6,44

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%