

CAIXA PPR INVESTIMENTO

31 julho 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 | | | | | 6.386,35 | 4.486.087,67 | 100,0% |
| 1. Valores Mobiliários Cotados | | | | | 6.386,35 | 2.640.490,38 | 58,9% |
| 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. | | | | | 6.386,35 | 2.626.357,05 | 58,5% |
| 1.2.1. Títulos De Dívida Pública | | | | | 6.386,35 | 1.749.349,09 | 39,0% |
| AUSTRIA, 0.75%, 20/03/2051, GOVT | 15.000,00 | 58,85% | EUR | 58,85% | 41,30 | 8.868,35 | 0,2% |
| AUSTRIA, 0.75%, 20/10/2026, GOVT | 215.000,00 | 96,03% | EUR | 96,03% | 1.260,04 | 207.715,94 | 4,6% |
| AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT | 167.000,00 | 96,59% | EUR | 96,59% | 768,66 | 162.078,97 | 3,6% |
| BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT | 42.000,00 | 62,21% | EUR | 62,21% | 296,85 | 26.425,05 | 0,6% |
| BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT | 60.000,00 | 90,05% | EUR | 90,05% | 773,32 | 54.800,92 | 1,2% |
| DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT | 65.000,00 | 77,97% | EUR | 77,97% | 0,00 | 50.682,45 | 1,1% |
| DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT | 56.000,00 | 75,74% | EUR | 75,74% | 0,00 | 42.416,08 | 0,9% |
| DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT | 159.000,00 | 52,87% | EUR | 52,87% | 0,00 | 84.056,94 | 1,9% |
| DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT | 3.000,00 | 91,79% | EUR | 91,79% | 3,44 | 2.757,11 | 0,1% |
| DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT | 218.000,00 | 94,82% | EUR | 94,82% | 1.049,40 | 207.765,72 | 4,6% |
| DBR, CZ, 15/02/2030, GOVT | 150.000,00 | 88,83% | EUR | 88,83% | 0,00 | 133.243,50 | 3,0% |
| DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT | 53.000,00 | 85,02% | EUR | 85,02% | 0,00 | 45.061,66 | 1,0% |
| EU, 0%, 04/10/2030, GOVT | 101.000,00 | 85,08% | EUR | 85,08% | 0,00 | 85.925,75 | 1,9% |
| FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT | 73.000,00 | 94,54% | EUR | 94,54% | 124,66 | 69.135,94 | 1,5% |
| FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT | 50.000,00 | 51,56% | EUR | 51,56% | 69,86 | 25.849,36 | 0,6% |
| FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT | 150.000,00 | 85,60% | EUR | 85,60% | 349,32 | 128.743,32 | 2,9% |
| FRTR, CZ, 25/11/2029, GOVT | 151.000,00 | 86,84% | EUR | 86,84% | 0,00 | 131.120,85 | 2,9% |
| NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT | 30.000,00 | 49,10% | EUR | 49,10% | 0,00 | 14.730,60 | 0,3% |
| NETHER, 0.75%, 15/07/2028, GOVT | 2.000,00 | 93,81% | EUR | 93,81% | 0,70 | 1.876,96 | 0,0% |
| NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT | 80.000,00 | 113,86% | EUR | 113,86% | 1.631,15 | 92.717,55 | 2,1% |
| OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT | 14.000,00 | 96,76% | EUR | 96,76% | 0,00 | 13.546,82 | 0,3% |
| SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT | 10.000,00 | 67,08% | EUR | 67,08% | 0,55 | 6.708,15 | 0,1% |
| SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT | 160.000,00 | 95,69% | EUR | 95,69% | 17,10 | 153.121,10 | 3,4% |
| 1.2.4. Acções | | | | | | 877.007,96 | 19,5% |
| ADIDAS, GY | 58,00 | 229,30 | EUR | 229,30 | | 13.299,40 | 0,3% |
| ADYEN NV, NA | 7,00 | 1.130,60 | EUR | 1.130,60 | | 7.914,20 | 0,2% |
| AHOLD DELHAIZE, NA | 191,00 | 29,78 | EUR | 29,78 | | 5.687,98 | 0,1% |
| AIR LIQUIDE, FP | 136,00 | 168,76 | EUR | 168,76 | | 22.951,36 | 0,5% |
| AIRBUS GROUP, FP | 157,00 | 139,94 | EUR | 139,94 | | 21.970,58 | 0,5% |
| AMADEUS, SA, SM | 160,00 | 60,74 | EUR | 60,74 | | 9.718,40 | 0,2% |
| AMUNDI, FP | 102,00 | 67,55 | EUR | 67,55 | | 6.890,10 | 0,2% |
| ASML HOLDING, NA | 94,00 | 850,40 | EUR | 850,40 | | 79.937,60 | 1,8% |
| ASR NEDERLAND NV, NA | 212,00 | 46,37 | EUR | 46,37 | | 9.830,44 | 0,2% |
| AXA, FP | 526,00 | 32,48 | EUR | 32,48 | | 17.084,48 | 0,4% |
| BANCO SABADELL, SM | 3.498,00 | 1,95 | EUR | 1,95 | | 6.826,35 | 0,2% |
| BANCO SANTANDER, SM | 4.047,00 | 4,45 | EUR | 4,45 | | 18.027,36 | 0,4% |
| BAYER, GY | 222,00 | 27,49 | EUR | 27,49 | | 6.101,67 | 0,1% |
| BMW, GY | 69,00 | 85,72 | EUR | 85,72 | | 5.914,68 | 0,1% |
| BNP PARIBAS, FP | 282,00 | 63,45 | EUR | 63,45 | | 17.892,90 | 0,4% |
| CAIXABANK SA, SM | 2.447,00 | 5,39 | EUR | 5,39 | | 13.179,54 | 0,3% |
| CAP GEMINI, FP | 67,00 | 183,60 | EUR | 183,60 | | 12.301,20 | 0,3% |
| CELLNEX TELECOM, SM | 220,00 | 32,18 | EUR | 32,18 | | 7.079,60 | 0,2% |
| CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF | 34,00 | 134,20 | CHF | 140,77 | | 4.786,32 | 0,1% |
| COMMERZBANK, GY | 490,00 | 15,17 | EUR | 15,17 | | 7.430,85 | 0,2% |
| CRH, LN, GBP | 124,00 | 66,30 | GBP | 78,57 | | 9.743,07 | 0,2% |
| DANONE, FP | 89,00 | 60,14 | EUR | 60,14 | | 5.352,46 | 0,1% |
| DEUTSCHE TELEKOM, GY | 825,00 | 24,11 | EUR | 24,11 | | 19.890,75 | 0,4% |
| DSM-FIRMENICH AG, NA | 75,00 | 118,00 | EUR | 118,00 | | 8.850,00 | 0,2% |
| ENEL, IM | 3.601,00 | 6,59 | EUR | 6,59 | | 23.744,99 | 0,5% |
| ENI SPA, IM | 651,00 | 14,80 | EUR | 14,80 | | 9.632,20 | 0,2% |
| ERSTE BANK AUSTRIA, AV | 143,00 | 48,18 | EUR | 48,18 | | 6.889,74 | 0,2% |
| ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL | 13,00 | 0,00 | EUR | 0,00 | | 0,00 | 0,0% |
| ESSILOR, FP | 54,00 | 211,70 | EUR | 211,70 | | 11.431,80 | 0,3% |
| ESSITY AB, SS, SEK | 181,00 | 301,50 | SEK | 25,96 | | 4.699,38 | 0,1% |
| FERRARI NV, IM | 31,00 | 380,30 | EUR | 380,30 | | 11.789,30 | 0,3% |
| FERROVIAL SE, SM | 146,00 | 37,00 | EUR | 37,00 | | 5.402,00 | 0,1% |
| FINECOBANK SPA, IM | 738,00 | 15,70 | EUR | 15,70 | | 11.586,60 | 0,3% |
| HEIDELBERCEMENT, GY | 40,00 | 96,64 | EUR | 96,64 | | 3.865,60 | 0,1% |
| HERMES, FP | 13,00 | 2.023,00 | EUR | 2.023,00 | | 26.299,00 | 0,6% |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM | 306,00 | 44,86 | EUR | 44,86 | | 13.727,16 | 0,3% |
| INFINEON, GY | 110,00 | 32,03 | EUR | 32,03 | | 3.522,75 | 0,1% |
| ING Groep, NA | 1.084,00 | 16,75 | EUR | 16,75 | | 18.157,00 | 0,4% |
| L' OREAL, FP | 46,00 | 400,40 | EUR | 400,40 | | 18.418,40 | 0,4% |
| LVMH, FP | 63,00 | 652,90 | EUR | 652,90 | | 41.132,70 | 0,9% |

| Designação | Quantidade | Cotação Moeda Origem | Moeda | Cotação (EUR) | Juro Decorrido (EUR) | Montante Global (EUR) | Peso |
|--|------------|----------------------------|-------|------------------|-------------------------|--------------------------|--------------|
| MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY | 189,00 | 61,10 | EUR | 61,10 | | 11.547,90 | 0,3% |
| MERCK KGAA, GY | 43,00 | 166,05 | EUR | 166,05 | | 7.140,15 | 0,2% |
| MICHELIN, FP | 127,00 | 36,59 | EUR | 36,59 | | 4.646,93 | 0,1% |
| MUNCHENER RUCK, GY | 37,00 | 456,20 | EUR | 456,20 | | 16.879,40 | 0,4% |
| NESTE OYJ, FH | 117,00 | 18,71 | EUR | 18,71 | | 2.188,49 | 0,0% |
| PERNOD-RICARD, FP | 61,00 | 124,00 | EUR | 124,00 | | 7.564,00 | 0,2% |
| PROSUS NV, NA | 242,00 | 32,12 | EUR | 32,12 | | 7.771,83 | 0,2% |
| PUIG BRANDS SA-B, SM | 290,00 | 25,78 | EUR | 25,78 | | 7.476,20 | 0,2% |
| RWE, GY | 195,00 | 34,35 | EUR | 34,35 | | 6.698,25 | 0,1% |
| SAFRAN, FP | 36,00 | 203,10 | EUR | 203,10 | | 7.311,60 | 0,2% |
| SANOFI-SYNTHELABO, FP | 230,00 | 95,33 | EUR | 95,33 | | 21.925,90 | 0,5% |
| SAP, GY | 160,00 | 195,06 | EUR | 195,06 | | 31.209,60 | 0,7% |
| SCHNEIDER, FP | 136,00 | 222,85 | EUR | 222,85 | | 30.307,60 | 0,7% |
| SIEMENS, GY | 191,00 | 169,68 | EUR | 169,68 | | 32.408,88 | 0,7% |
| SOCIETE GENERALE, FP | 345,00 | 23,97 | EUR | 23,97 | | 8.269,65 | 0,2% |
| SPIE SA, FP | 131,00 | 35,72 | EUR | 35,72 | | 4.679,32 | 0,1% |
| ST.GOBAIN, FP | 127,00 | 79,44 | EUR | 79,44 | | 10.088,88 | 0,2% |
| STELLANTIS NV, IM | 633,00 | 15,40 | EUR | 15,40 | | 9.749,47 | 0,2% |
| STMICROELECTRONICS, FP | 248,00 | 30,60 | EUR | 30,60 | | 7.588,80 | 0,2% |
| THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF) | 43,00 | 146,90 | EUR | 146,90 | | 6.316,70 | 0,1% |
| TOTALENERGIES SE, FP | 433,00 | 62,48 | EUR | 62,48 | | 27.053,84 | 0,6% |
| UNICREDIT, IM | 569,00 | 37,96 | EUR | 37,96 | | 21.596,40 | 0,5% |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA | 299,00 | 21,99 | EUR | 21,99 | | 6.575,01 | 0,1% |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP | 270,00 | 29,04 | EUR | 29,04 | | 7.840,80 | 0,2% |
| VINCI, FP | 139,00 | 105,55 | EUR | 105,55 | | 14.671,45 | 0,3% |
| VONOVIA SE, GY | 300,00 | 28,47 | EUR | 28,47 | | 8.541,00 | 0,2% |
| 1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E. | | | | | 0,00 | 14.133,33 | 0,3% |
| 1.3.4. Acções | | | | | 0,00 | 14.133,33 | 0,3% |
| ASHTREAD GROUP, LN, GBP | 64,00 | 55,90 | GBP | 66,25 | | 4.239,87 | 0,1% |
| OCADO, LN, GBP | 441,00 | 4,05 | GBP | 4,80 | | 2.118,24 | 0,0% |
| RECKITT BENCKISER, LN, GBP | 69,00 | 41,77 | GBP | 49,50 | | 3.415,66 | 0,1% |
| SHELL PLC, NA | 129,00 | 33,80 | EUR | 33,80 | | 4.359,56 | 0,1% |
| 3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo | | | | | | 1.666.211,47 | 37,1% |
| 3.1. Fundos Harmonizados | | | | | | 1.666.211,47 | 37,1% |
| BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM) | 3.376,55 | 214,25 | EUR | 214,25 | | 723.426,05 | 16,1% |
| ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF | 684,00 | 110,83 | EUR | 110,83 | | 75.807,72 | 1,7% |
| ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF | 555,00 | 50,88 | EUR | 50,88 | | 28.238,40 | 0,6% |
| VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM) | 4.290,48 | 168,30 | EUR | 168,30 | | 722.087,78 | 16,1% |
| X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF | 1.241,00 | 94,00 | EUR | 94,00 | | 116.651,52 | 2,6% |
| 4. Imobiliário | | | | | | 72.204,22 | 1,6% |
| 4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário | | | | | | 72.204,22 | 1,6% |
| FUNDIMO (FII) | 8.427,00 | 8,57 | EUR | 8,57 | | 72.204,22 | 1,6% |
| 5. Liquidez | | | | | | 105.359,68 | 2,3% |
| 5.1. À Vista | | | | | 0,00 | 105.359,68 | 2,3% |
| Depósitos à Ordem | | | | | 0,00 | 105.359,68 | 2,3% |
| 9. Outros Activos | | | | | | 1.821,92 | 0,0% |
| 9.1. Outros Devedores E Credores | | | | | | 1.821,92 | 0,0% |
| Juros de D.O. a Regularizar | | | | | | 243,55 | 0,0% |
| Transacções a Liquidar | | | | | 0,00 | 121,45 | 0,0% |
| Impostos a Regularizar | | | | | | 9.029,66 | 0,2% |
| Comissões | | | | | | -7.572,74 | -0,2% |

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

4.486.087,67

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

687.645,67

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%;

- 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% |

| 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% |