

## LEVE DUO

31 março 2023

O produto LEVE DUO teve o início de comercialização em 09/04/2007. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31 março 2022, sendo que as valorizações utilizadas correspondem às cotações disponíveis no último dia útil do período.

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>6.352.760,30</b>	<b>433.467.015,82</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>6.062.168,27</b>	<b>414.129.505,56</b>	<b>95,5%</b>
<b>1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal</b>					<b>1.421.006,90</b>	<b>59.964.636,90</b>	<b>13,8%</b>
<b>1.1.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>1.379.720,33</b>	<b>50.962.638,33</b>	<b>11,8%</b>
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	96,99%	EUR	96,99%	46.352,47	2.956.112,47	0,7%
PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT	5.000.000,00	106,98%	EUR	106,98%	23.821,72	5.372.871,72	1,2%
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	31.000.000,00	104,57%	EUR	104,57%	1.229.835,87	33.644.985,87	7,8%
REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	89,09%	EUR	89,09%	79.710,27	8.988.710,27	2,1%
<b>1.1.3. Obrigações Diversas</b>					<b>41.286,57</b>	<b>9.001.956,57</b>	<b>2,1%</b>
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP	9.000.000,00	99,56%	EUR	99,56%	41.286,57	9.001.956,57	2,1%
<b>1.1.4. Acções</b>					<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
BES, PL (EM LIQUIDACAO)	99.815,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>3.686.991,91</b>	<b>269.687.014,08</b>	<b>62,2%</b>
<b>1.2.1. Títulos De Dívida Pública</b>					<b>3.276.438,82</b>	<b>233.275.638,42</b>	<b>53,8%</b>
BOTS, CZ, 14/06/2024, GOVT	10.000.000,00	99,26%	EUR	99,26%	0,00	9.926.000,00	2,3%
BTPS, 0.35%, 17/11/2028, GOVT	2.000.000,00	88,69%	EUR	88,69%	4.450,55	1.778.190,55	0,4%
BTPS, 2.5%, 01/12/2024, GOVT	5.000.000,00	99,30%	EUR	99,30%	41.325,13	5.006.175,13	1,2%
BTPS, 2.65%, 01/12/2027, GOVT	5.000.000,00	98,45%	EUR	98,45%	43.804,64	4.966.154,64	1,1%
BTPS, 3.75%, 01/09/2024, GOVT	1.500.000,00	100,00%	EUR	100,00%	4.585,60	1.504.540,60	0,3%
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	14.000.000,00	106,52%	EUR	106,52%	54.211,96	14.967.151,96	3,5%
BTPS, 5.25%, 01/11/29, GOVT	4.000.000,00	110,42%	EUR	110,42%	87.692,33	4.504.332,33	1,0%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	14.000.000,00	111,43%	EUR	111,43%	377.499,94	15.977.559,94	3,7%
JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, GOVT	1.590.000,00	91,84%	EUR	91,84%	20.405,00	1.480.724,60	0,3%
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	94,92%	EUR	94,92%	111.475,41	19.095.675,41	4,4%
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	900.000,00	93,15%	EUR	93,15%	12.980,07	851.294,07	0,2%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	3.000.000,00	82,32%	EUR	82,32%	2.754,10	2.472.324,10	0,6%
SPGB, 0.6%, 31/10/2029, GOVT	5.000.000,00	88,65%	EUR	88,65%	12.459,02	4.445.059,02	1,0%
SPGB, 2.75%, 31/10/2024, GOVT	23.900.000,00	99,46%	EUR	99,46%	272.956,28	24.044.852,28	5,5%
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	24.500.000,00	109,96%	EUR	109,96%	524.005,46	27.464.450,46	6,3%
SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT	30.000.000,00	120,20%	EUR	120,20%	1.154.713,11	37.215.013,11	8,6%
SPGB, 5.9%, 30/07/2026, GOVT	2.000.000,00	106,42%	EUR	106,42%	78.989,07	2.207.369,07	0,5%
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	48.000.000,00	114,37%	EUR	114,37%	472.131,15	55.368.771,15	12,8%
<b>1.2.3. Obrigações Diversas</b>					<b>410.553,09</b>	<b>36.411.375,66</b>	<b>8,4%</b>
ACCOR, 2.375%, 29/11/2028, CORP, CALL	3.500.000,00	95,23%	EUR	95,23%	27.935,45	3.361.055,45	0,8%
ALD SA, 4.25%, 18/01/2027, CORP	1.500.000,00	101,38%	EUR	101,38%	12.715,16	1.533.355,16	0,4%
BANCO SANTANDER, 3.25%, 04/04/2026, CORP	4.100.000,00	98,71%	EUR	98,71%	131.793,72	4.179.067,72	1,0%
BANCO SANTANDER, VAR, 18/10/2027, CORP, CALL	2.000.000,00	101,74%	EUR	101,74%	41.700,82	2.076.500,82	0,5%
BBVA, 0.375%, 02/10/2024, CORP	400.000,00	98,30%	EUR	98,30%	741,80	393.957,80	0,1%
BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP	2.600.000,00	92,22%	EUR	92,22%	2.734,97	2.400.350,97	0,6%
BNP PARIBAS, 2.875%, 01/10/2026, CORP	2.000.000,00	97,86%	EUR	97,86%	28.592,90	1.985.772,90	0,5%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0%, 25/05/2029, CORP	1.000.000,00	86,61%	EUR	86,61%	0,00	866.120,00	0,2%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0,6%, 25/11/2029, CORP	1.000.000,00	88,48%	EUR	88,48%	2.081,97	886.841,97	0,2%
CAIXABANK, 0.625%, 01/10/2024, CORP	5.000.000,00	98,45%	EUR	98,45%	15.539,62	4.937.989,62	1,1%
CREDIT AGRICOLE, 2.7%, 15/07/2025, CORP	300.000,00	98,21%	EUR	98,21%	1.691,21	296.306,21	0,1%
CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP	175.000,00	97,76%	EUR	97,76%	876,92	171.960,42	0,0%
CRITERIA CAIXA, 1.375%, 10/04/2024, CORP	2.000.000,00	99,95%	EUR	99,95%	26.801,71	2.025.741,71	0,5%
DELL BANK, 1.625%, 24/06/2024, CORP, CALL	1.000.000,00	99,47%	EUR	99,47%	12.476,09	1.007.176,09	0,2%
EP INFRASTRUCTURE, 1.659%, 26/04/2024, CORP, CALL	4.000.000,00	99,70%	EUR	99,70%	61.645,90	4.049.725,90	0,9%
FORVIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	1.050.000,00	94,25%	EUR	94,25%	7.273,44	996.898,44	0,2%
FRESENIUS SE & CO KGAA, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	500.000,00	100,96%	EUR	100,96%	17.882,51	522.692,51	0,1%
RYANAIR DAC, 0.875%, 25/05/2026, CORP	939.000,00	94,41%	EUR	94,41%	6.981,57	893.519,64	0,2%
SECURITAS TREASURY IRELAND, 4.375%, 06/03/2029, CORP, CALL	3.700.000,00	103,12%	EUR	103,12%	11.087,33	3.826.342,33	0,9%

Designação		Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
<b>1.3.</b>	<b>Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.</b>					<b>954.169,46</b>	<b>84.477.854,58</b>	<b>19,5%</b>
<b>1.3.3.</b>	<b>Obrigações Diversas</b>					<b>954.169,46</b>	<b>84.477.854,58</b>	<b>19,5%</b>
	ASHTeAD, 4%, 01/05/2028, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	94,02%	USD	86,97%	30.832,79	1.770.227,85	0,4%
	BARCLAYS, 3%, 08/05/2026, CORP, GBP	2.000.000,00	95,50%	GBP	111,68%	62.882,10	2.296.562,37	0,5%
	BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	11.500.000,00	99,67%	USD	92,20%	221.056,68	10.823.586,51	2,5%
	BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL	400.000,00	96,46%	EUR	96,46%	376,99	386.228,99	0,1%
	BOEING CO, 4.875%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL	500.000,00	98,89%	USD	91,47%	9.394,37	466.757,24	0,1%
	CANARY WHARF, 2.625%, 23/04/2025, CORP, GBP, CALL	4.300.000,00	92,71%	GBP	108,42%	57.705,83	4.719.919,61	1,1%
	CGNPC INTERNATIONAL LTD, 2%, 11/09/2025, CORP	2.000.000,00	96,50%	EUR	96,50%	22.076,50	1.952.136,50	0,5%
	CORNWALL JERSEY, 0.75%, 16/04/2026, CORP, GBP, CALL, CONV	1.500.000,00	62,99%	GBP	73,67%	6.003,04	1.111.049,23	0,3%
	DRAX, 6.625%, 01/11/2025, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	99,10%	USD	91,67%	38.300,11	1.413.357,92	0,3%
	DS SMITH, 4.375%, 27/07/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	102,13%	EUR	102,13%	29.644,81	1.050.944,81	0,2%
	EBAY, 3.45%, 01/08/2024, CORP, USD, CALL	5.000.000,00	99,20%	USD	91,76%	26.593,28	4.614.374,25	1,1%
	ENERGY TRANSFER, 4.2%, 15/04/2027, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	97,28%	USD	89,98%	35.827,72	1.835.383,73	0,4%
	EXPEDIA GROUP, 6.25%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	100,47%	USD	92,93%	36.132,18	1.430.142,91	0,3%
	FREEMPORT-MCMORAN INC, 4.125%, 01/03/2028, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	95,65%	USD	88,47%	3.179,63	887.898,90	0,2%
	FUQING INV, 3.25%, 23/06/2025, CORP, USD	30.000.000,00	90,54%	USD	83,75%	245.506,18	25.371.026,48	5,9%
	HESS, 3.5%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL	1.600.000,00	99,29%	USD	91,84%	10.935,36	1.480.342,44	0,3%
	INTERNATIONAL GAME TECH, 3.5%, 15/06/2026, CORP, CALL	1.100.000,00	98,75%	EUR	98,75%	11.336,11	1.097.586,11	0,3%
	MEITUAN, 2.125%, 28/10/2025, CORP, USD, CALL	200.000,00	94,65%	USD	87,55%	1.670,75	176.768,34	0,0%
	MET LIFE, 0.375%, 09/04/2024, CORP	5.000.000,00	99,94%	EUR	99,94%	18.288,93	5.015.288,93	1,2%
	MPT OPER, 3.325%, 24/03/2025, CORP, CALL	1.000.000,00	94,10%	EUR	637,67	637,67	941.667,67	0,2%
	NISSAN MOTOR, 2.652%, 17/03/2026, CORP, CALL	1.500.000,00	97,45%	EUR	97,45%	1.525,81	1.463.305,81	0,3%
	PHILIP MORRIS, 0.625%, 08/11/2024, CORP, CALL	3.700.000,00	98,09%	EUR	98,09%	9.098,36	3.638.502,36	0,8%
	SINOCHONG OFFSHORE, 1.625%, 29/10/2025, CORP, USD	1.000.000,00	93,93%	USD	86,89%	6.304,67	875.169,72	0,2%
	T-MOBILE USA, 2.25%, 15/02/2026, CORP, USD, CALL	1.500.000,00	94,61%	USD	87,52%	3.988,99	1.316.721,40	0,3%
	TOWER BERSAMA, 2.75%, 20/01/2026, CORP, CALL, USD	1.800.000,00	94,52%	USD	87,43%	9.030,16	1.582.810,57	0,4%
	UNITED RENTALS, 4.875%, 15/01/2028, CORP, USD, CALL	2.500.000,00	97,25%	USD	89,96%	23.799,07	2.272.712,22	0,5%
	UTAH ACQUISITION SUB, 2.25%, 22/11/2024, CORP, CALL	1.000.000,00	98,88%	EUR	98,88%	7.991,80	996.751,80	0,2%
	ZHONGSHENG, 3%, 13/01/2026, CORP, USD, CALL	4.000.000,00	93,69%	USD	86,66%	24.049,57	3.490.629,91	0,8%
<b>2.</b>	<b>Valores Não Cotados</b>					<b>290.592,03</b>	<b>20.036.326,85</b>	<b>4,6%</b>
<b>2.2.</b>	<b>Valores Mobiliários Estrangeiros</b>					<b>278.780,18</b>	<b>20.036.326,85</b>	<b>4,6%</b>
<b>2.2.3.</b>	<b>Obrigações Diversas</b>					<b>290.592,03</b>	<b>20.036.326,85</b>	<b>4,6%</b>
	AMERICAN AIRLINES, 4.95%, 15/02/2025 (EXT DT 2026) CORP, SINK, USD	759.500,00	98,36%	USD	90,98%	4.443,47	695.447,26	0,2%
	DELTA AIR LINES, 4.5%, 20/10/2025, CORP, USD, SINK, 144A	1.164.624,99	98,99%	USD	91,56%	9.560,68	1.075.896,54	0,2%
	ENERGY TRANSFER OPER, 5.5%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL	1.800.000,00	100,65%	USD	93,10%	30.524,47	1.706.367,59	0,4%
	IQVIA, 5%, 15/10/2026, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	97,90%	USD	90,56%	63.978,05	2.780.683,26	0,6%
	LITHIA MOTORS, 4.625%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL 144A	2.000.000,00	95,99%	USD	88,79%	25.192,96	1.800.958,38	0,4%
	MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL	3.000.000,00	100,33%	USD	92,80%	48.002,79	2.832.083,82	0,7%
	NEXTRA ENERGY OP, 4.25%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	99,20%	USD	91,76%	24.897,49	2.777.732,57	0,6%
	OPEN TEXT, 6.9%, 01/12/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	103,45%	USD	95,69%	31.646,01	1.467.059,01	0,3%
	QORVO, 1.75%, 15/12/2024, CORP, CALL, USD	1.250.000,00	96,99%	USD	89,72%	5.957,79	1.127.431,30	0,3%
	SMITHFIELD FOODS, 4.25%, 01/02/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.000.000,00	96,10%	USD	88,89%	6.551,97	895.470,66	0,2%
	TRITON CONTAINER, 2.05%, 15/04/2026, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	92,11%	USD	85,20%	17.487,32	1.721.511,01	0,4%
	UNITED AIRLINES, 4.15%, 11/04/2024 (EX DT 2025), CORP, USD, SINK	581.293,77	99,81%	USD	92,32%	10.537,18	547.197,52	0,1%
	VISTRA OPERATIONS, 5.125%, 13/05/2025, CORP, USD, 144A	650.000,00	99,24%	USD	91,80%	11.811,85	608.487,93	0,1%
<b>3.</b>	<b>Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>					<b>0,00</b>	<b>41.996,97</b>	<b>0,0%</b>
<b>3.1.</b>	<b>Fundos Harmonizados</b>					<b>0,00</b>	<b>41.996,97</b>	<b>0,0%</b>
	AXA WRLD EUR INF PLS-IEURACC (FIM)	386,36	108,70	EUR	108,70		41.996,97	0,0%
<b>5.</b>	<b>Liquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>-731.702,17</b>	<b>-0,2%</b>
<b>5.1.</b>	<b>À Vista</b>					<b>0,00</b>	<b>-731.702,17</b>	<b>-0,2%</b>
	Depósitos à Ordem					0,00	-731.702,17	-0,2%
<b>7.</b>	<b>Operações Com Produtos Derivados</b>					<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<b>7.1.</b>	<b>Em Mercado Regulamentado</b>					<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<b>7.1.1.</b>	<b>Futuros</b>					<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
	EURGBP FX CURR FUT JUN24	64,00	0,00	GBP	0,00		0,00	0,0%
	EURUSD FX CURR FUT JUN24	629,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
<b>9.</b>	<b>Outros Activos</b>					<b>0,00</b>	<b>-9.111,39</b>	<b>0,0%</b>
<b>9.1.</b>	<b>Outros Devedores E Credores</b>					<b>0,00</b>	<b>-9.111,39</b>	<b>0,0%</b>
	Juros de D.O. a Regularizar					0,00	-9.111,39	0,0%

O património do Fundo será representado por investimentos, preferencialmente expressos em euros e no máximo de 10% em outras moedas, nos seguintes instrumentos:

- a) 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%;
- b) Imóveis ou fundos de investimento imobiliários e respectivos derivados numa percentagem máxima de 25%;
- 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.