

## LEVE TRI

31 março 2024

O produto LEVE TRI (PPR Acções – ICAE) teve o início de comercialização em 09/04/2007. 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 período.

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>5.410,83</b>	<b>4.448.064,23</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>5.410,83</b>	<b>4.448.064,23</b>	<b>100,0%</b>
<b>1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal</b>					<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<b>1.1.4. Acções</b>						<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
BANIF, PL	247.226,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
BES, PL (EM LIQUIDACAO)	22.523,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>5.410,83</b>	<b>4.448.064,23</b>	<b>100,0%</b>
<b>1.2.1. Títulos da Dívida Pública</b>					<b>5.410,83</b>	<b>1.314.531,76</b>	<b>29,6%</b>
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	85.000,00	96,42%	EUR	96,42%	1.744,59	83.699,04	1,9%
BKO, 0.2%, 24/06/2024, GOVT	60.000,00	99,30%	EUR	99,30%	95,41	59.675,41	1,3%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	7.000,00	83,64%	EUR	83,64%	21,98	5.876,92	0,1%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	30.000,00	62,32%	EUR	62,32%	41,58	18.736,68	0,4%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	40.000,00	89,74%	EUR	89,74%	101,09	35.997,49	0,8%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	10.000,00	75,23%	EUR	75,23%	0,00	7.522,80	0,2%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	107.000,00	53,36%	EUR	53,36%	0,00	57.089,85	1,3%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	167.000,00	90,76%	EUR	90,76%	51,33	151.622,20	3,4%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	25.000,00	93,81%	EUR	93,81%	78,29	23.531,54	0,5%
DBR, 0.5%, 15/02/2032, GOVT	200.000,00	84,10%	EUR	84,10%	0,00	168.190,00	3,8%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	84,33%	EUR	84,33%	0,00	30.357,72	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	264.000,00	93,64%	EUR	93,64%	229,02	247.438,62	5,6%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	13.000,00	53,79%	EUR	53,79%	82,85	7.075,29	0,2%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	90.000,00	86,27%	EUR	86,27%	955,94	78.599,84	1,8%
IRISH, 1% 15/05/2026, GOVT	45.000,00	96,38%	EUR	96,38%	394,67	43.765,22	1,0%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	28.000,00	92,48%	EUR	92,48%	13,46	25.906,74	0,6%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	10.000,00	49,51%	EUR	49,51%	0,00	4.951,20	0,1%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	73.000,00	114,90%	EUR	114,90%	568,44	84.442,52	1,9%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	7.000,00	92,94%	EUR	92,94%	37,30	6.543,10	0,1%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	20.000,00	95,67%	EUR	95,67%	0,00	19.133,80	0,4%
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	20.000,00	72,31%	EUR	72,31%	22,27	14.484,67	0,3%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	60.000,00	59,33%	EUR	59,33%	13,56	35.608,56	0,8%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	46.000,00	83,66%	EUR	83,66%	95,52	38.577,74	0,9%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	12.000,00	66,24%	EUR	66,24%	80,33	8.029,61	0,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	60.000,00	94,82%	EUR	94,82%	783,20	57.675,20	1,3%
<b>1.2.4. Acções</b>						<b>3.133.532,47</b>	<b>70,4%</b>
ADIDAS, GY	135,00	207,35	EUR	207,35		27.992,25	0,6%
ADYEN NV, NA	15,00	1.567,80	EUR	1.567,80		23.517,00	0,5%
AHOLD DELHAIZE, NA	452,00	27,72	EUR	27,72		12.527,18	0,3%
AIR LIQUIDE, FP	291,00	192,82	EUR	192,82		56.110,62	1,3%
AIRBUS GROUP, FP	383,00	170,72	EUR	170,72		65.385,76	1,5%
AMADEUS, SA, SM	356,00	59,42	EUR	59,42		21.153,52	0,5%
AMUNDI, FP	242,00	63,65	EUR	63,65		15.403,30	0,3%
ASML HOLDING, NA	221,00	892,10	EUR	892,10		197.154,10	4,4%
ASR NEDERLAND NV, NA	501,00	45,38	EUR	45,38		22.735,38	0,5%
AXA, FP	1.238,00	34,81	EUR	34,81		43.094,78	1,0%
BANCO SABADELL, SM	12.951,00	1,45	EUR	1,45		18.837,23	0,4%
BANCO SANTANDER, SM	9.531,00	4,50	EUR	4,50		42.913,34	1,0%
BAYER, GY	522,00	28,40	EUR	28,40		14.824,80	0,3%
BMW, GY	165,00	106,86	EUR	106,86		17.631,90	0,4%
BNP PARIBAS, FP	668,00	65,85	EUR	65,85		43.987,80	1,0%
CAIXABANK SA, SM	5.762,00	4,86	EUR	4,86		28.020,61	0,6%
CAP GEMINI, FP	161,00	213,20	EUR	213,20		34.325,20	0,8%
CARREFOUR, FP	617,00	15,88	EUR	15,88		9.794,88	0,2%
CELLNEX TELECOM, SM	520,00	32,77	EUR	32,77		17.040,40	0,4%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	79,00	137,50	CHF	140,79		11.122,77	0,3%
COMMERZBANK, GY	1.157,00	12,70	EUR	12,70		14.688,12	0,3%
CRH, LN, GBP	291,00	68,28	GBP	79,85		23.236,44	0,5%
DANONE, FP	209,00	59,88	EUR	59,88		12.514,92	0,3%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1.947,00	22,53	EUR	22,53		43.865,91	1,0%
DHL GROUP, GY	320,00	39,92	EUR	39,92		12.774,40	0,3%
DSM-FIRMENICH AG, NA	175,00	105,40	EUR	105,40		18.445,00	0,4%
ENEL, IM	8.437,00	6,12	EUR	6,12		51.626,00	1,2%
ENI SPA, IM	1.541,00	14,65	EUR	14,65		22.572,57	0,5%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	508,00	41,22	EUR	41,22		20.939,76	0,5%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	127,00	209,65	EUR	209,65		26.625,55	0,6%
ESSITY AB, SS, SEK	427,00	254,10	SEK	22,05		9.414,38	0,2%
FERRARI NV, IM	72,00	404,00	EUR	404,00		29.088,00	0,7%
FERROVIAL, SE	357,00	37,06	EUR	37,06		13.230,42	0,3%
FINCOBANK SPA, IM	1.738,00	13,88	EUR	13,88		24.123,44	0,5%
HEIDELBERCEMENT, GY	214,00	102,10	EUR	102,10		21.849,40	0,5%
HERMES, FP	25,00	2.365,50	EUR	2.365,50		59.137,50	1,3%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	720,00	46,66	EUR	46,66		33.595,20	0,8%
INFINEON, GY	592,00	31,51	EUR	31,51		18.653,92	0,4%
ING Groep, NA	2.810,00	15,24	EUR	15,24		42.835,64	1,0%
L' OREAL, FP	122,00	438,65	EUR	438,65		53.515,30	1,2%
LVMH, FP	146,00	833,60	EUR	833,60		121.705,60	2,7%
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	441,00	73,84	EUR	73,84		32.563,44	0,7%
MERCK KGAA, GY	103,00	163,90	EUR	163,90		16.881,70	0,4%
MICHELIN, FP	297,00	35,52	EUR	35,52		10.549,44	0,2%
NESTE OYJ, FH	274,00	25,08	EUR	25,08		6.871,92	0,2%
PERNOD-RICARD, FP	143,00	149,95	EUR	149,95		21.442,85	0,5%
PROSUS NV, NA	569,00	29,08	EUR	29,08		16.543,68	0,4%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
RWE, GY	459,00	31,42	EUR	31,42		14.421,78	0,3%
SAFRAN, FP	82,00	210,00	EUR	210,00		17.220,00	0,4%
SAMPO OYJ, FH	230,00	39,53	EUR	39,53		9.091,90	0,2%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	544,00	90,96	EUR	90,96		49.482,24	1,1%
SAP, GY	380,00	180,66	EUR	180,66		68.650,80	1,5%
SCHNEIDER, FP	318,00	209,65	EUR	209,65		66.688,70	1,5%
SIEMENS, GY	456,00	176,96	EUR	176,96		80.693,76	1,8%
SOCIETE GENERALE, FP	812,00	24,81	EUR	24,81		20.141,66	0,5%
ST.GOBAIN, FP	297,00	71,92	EUR	71,92		21.360,24	0,5%
STELLANTIS NV, IM	1.484,00	26,34	EUR	26,34		39.088,56	0,9%
STMICROELECTRONICS, FP	309,00	39,92	EUR	39,92		12.335,28	0,3%
THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	102,00	158,05	EUR	158,05		16.121,10	0,4%
TOTALENERGIES SE, FP	1.019,00	63,47	EUR	63,47		64.675,94	1,5%
UNICREDIT, IM	1.539,00	35,17	EUR	35,17		54.118,94	1,2%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	708,00	27,87	EUR	27,87		19.731,96	0,4%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	632,00	30,13	EUR	30,13		19.042,16	0,4%
VINCI, FP	308,00	118,76	EUR	118,76		36.578,08	0,8%
VONOVIA SE, GY	709,00	27,33	EUR	27,33		19.376,97	0,4%
<b>1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.</b>					<b>0,00</b>	<b>33.525,22</b>	<b>0,8%</b>
<b>1.3.4. Acções</b>					<b>0,00</b>	<b>33.525,22</b>	<b>0,8%</b>
ASHTREAD GROUP, LN, GBP	149,00	56,38	GBP	65,93		9.824,14	0,2%
OCADO, LN, GBP	1.038,00	4,55	GBP	5,32		5.524,44	0,1%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	165,00	45,11	GBP	52,75		8.704,42	0,2%
SHELL PLC, NA	306,00	30,96	EUR	30,96		9.472,23	0,2%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>					<b>0,00</b>	<b>654.880,08</b>	<b>14,7%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>					<b>0,00</b>	<b>654.880,08</b>	<b>14,7%</b>
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	8,00	11.259,40	EUR	11.259,40		90.075,20	2,0%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	101,55	210,15	EUR	210,15		21.340,52	0,5%
GROUPAMA MONETAIRE	0,04	222.016,84	EUR	222.016,84		8.436,64	0,2%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	2.391,00	110,82	EUR	110,82		264.958,67	6,0%
ISHARES EUROSXXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	907,00	51,88	EUR	51,88		47.055,16	1,1%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM), ETF	426,00	110,52	EUR	110,52		47.081,52	1,1%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	128,58	165,31	EUR	165,31		21.254,73	0,5%
XUSD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1.657,00	93,35	EUR	93,35		154.677,64	3,5%
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>210.588,76</b>	<b>4,7%</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>210.588,76</b>	<b>4,7%</b>
FUNDIMO (FI)	24.590,00	8,56	EUR	8,56		210.588,76	4,7%
<b>5. Líquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>91.131,19</b>	<b>2,0%</b>
<b>5.1. À Vista</b>					<b>0,00</b>	<b>91.131,19</b>	<b>2,0%</b>
Depósitos à Ordem					0,00	91.131,19	2,0%
<b>9. Outros Activos</b>					<b>0,00</b>	<b>11.743,83</b>	<b>0,3%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>					<b>0,00</b>	<b>11.743,83</b>	<b>0,3%</b>
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	142,92	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	2.585,11	0,1%
Impostos a Regularizar					0,00	15.547,45	0,3%
Comissões					0,00	-6.531,65	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

4.448.064,23

729.347,10

6,10

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, numa percentagem mínima de 40% e máxima de 55%;
- Imóveis ou fundos de investimento imobiliários e respectivos derivados numa percentagem máxima de 25%;
- 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;
- Operações de reporte e de empréstimo de valores, sem prejuízo do disposto nas alíneas anteriores.

Junto segue histórico de rentabilidade e volatilidade deste fundo apurado de acordo com a Metodologia definida no Regulamento 2/2012 da CMVM.

Ano	Rendibilidade	Volatilidade
2008	-21,35%	14,29%
2009	12,13%	10,39%
2010	-1,04%	11,06%
2011	-7,30%	13,27%
2012	11,06%	7,83%
2013	10,76%	7,91%
2014	1,18%	9,63%
2015	6,19%	11,04%
2016	-1,84%	10,08%
2017	1,51%	5,45%
2018	-9,19%	8,20%
2019	10,48%	5,98%
2020	1,55%	16,87%
2021	9,98%	6,33%
2022	-13,17%	11,31%
2023	11,84%	8,60%

	Rend. Anualizada
1 Ano	11,84%
3 Anos	2,22%
5 Anos	3,68%
Desde o Inicio	0,92%

As rendibilidades divulgadas representam dados passados, não constituindo garantia de rentabilidade futura.