

IB LEVE II

31 março 2020

O produto LEVE II teve o início da comercialização em 13/03/2008. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31/03/2020, 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
Parte I - Valores Patrimoniais					61.215,15	9.272.755,81	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					61.215,15	8.665.170,57	93,4%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					36.435,22	3.624.177,97	39,1%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					28.006,06	2.744.600,81	29,6%
PGB, 2.875%, 15/10/2025, GOVT	1.859.000,00	113,53%	EUR	113,53%	24.532,70	2.134.962,45	23,0%
PGB, 5.65%, 15/02/2024, GOVT	500.000,00	121,23%	EUR	121,23%	3.473,36	609.638,36	6,6%
1.1.3. Obrigações Diversas					8.429,16	879.577,16	9,5%
SAUDACOR, FRN, 20/06/2022, CORP	850.000,00	102,49%	EUR	102,49%	8.429,16	879.577,16	9,5%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					9.130,81	3.652.221,97	39,4%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					7.006,50	3.371.221,16	36,4%
BTPS, 0.05%, 15/04/2021, GOVT	1.700.000,00	99,83%	EUR	99,83%	390,16	1.697.551,16	18,3%
BTPS, 0.2%, 15/10/2020, GOVT	500.000,00	100,01%	EUR	100,01%	459,02	500.529,02	5,4%
BTPS, 0.95%, 01/03/2023, GOVT	400.000,00	101,13%	EUR	101,13%	309,78	404.813,78	4,4%
NETHERLANDS, 3.75%, 15/01/2023, GOVT	12.000,00	112,32%	EUR	112,32%	93,44	13.571,60	0,1%
SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT	650.000,00	115,23%	EUR	115,23%	5.754,10	754.755,60	8,1%
1.2.3. Obrigações Diversas					2.124,31	281.000,81	3,0%
IGT, 4.75%, 15/02/2023, CORP, CALL	350.000,00	79,68%	EUR	79,68%	2.124,31	281.000,81	3,0%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					15.649,12	1.388.770,63	15,0%
1.3.3. Obrigações Diversas					15.649,12	1.388.770,63	15,0%
AMERICA MOVIL, CZ, 28/05/2020, CORP, CONV	555.000,00	98,92%	EUR	98,92%	0,00	548.994,90	5,9%
AMERICAN AIRLINES, 3.7%, 01/05/2023 (EXT DT 2024) CORP, SINK, USD	191.303,93	86,56%	USD	79,00%	2.691,92	153.826,56	1,7%
AMG CAPITAL TRUST, SUB, 5.15%, 15/10/2037, USD, CONV	7.000,00	35,00%	USD	31,95%	3.473,24	227.095,00	2,4%
BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	500.000,00	98,47%	USD	89,87%	9.483,96	458.854,17	4,9%
5. Liquidez					0,00	604.167,98	6,5%
5.1. À Vista						604.167,98	6,5%
Depósitos à Ordem						604.167,98	6,5%
7. Operações Com Produtos Derivados						0,00	0,0%
7.1. Em Mercado Regulamentado						0,00	0,0%
7.1.1. Futuros						0,00	0,0%
EURUSD FX CURR FUT JUN20	6,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9. Outros Activos						3.417,26	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores						3.417,26	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						0,01	0,0%
Impostos a Regularizar						3.417,25	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:

- 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 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.