

IB LEVE I

31 dezembro 2020

O produto LEVE I teve o início da comercialização em 13/03/2008. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 31/12/2020, 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 | | | | | 1.107.961,44 | 94.867.349,32 | 100,0% |
| 1. Valores Mobiliários Cotados | | | | | 1.107.961,44 | 92.531.812,81 | 97,5% |
| 1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal | | | | | 675.524,73 | 52.080.224,45 | 54,9% |
| 1.1.1. Títulos De Dívida Pública | | | | | 669.027,11 | 45.496.438,83 | 48,0% |
| PGB, 2.2%, 17/10/2022, GOVT | 6.977.743,00 | 105,26% | EUR | 105,26% | 31.543,24 | 7.376.524,85 | 7,8% |
| PGB, 3.85%, 15/04/2021, GOVT | 9.636.000,00 | 101,27% | EUR | 101,27% | 264.264,12 | 10.022.448,60 | 10,6% |
| PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT | 8.000.000,00 | 128,04% | EUR | 128,04% | 235.972,61 | 10.478.932,61 | 11,0% |
| PGB, 4.95%, 25/10/2023, GOVT | 15.104.841,00 | 115,73% | EUR | 115,73% | 137.247,14 | 17.618.532,77 | 18,6% |
| 1.1.3. Obrigações Diversas | | | | | 6.497,62 | 6.583.785,62 | 6,9% |
| BANCO BPI, 0,25%, 22/03/2024, CORP | 3.100.000,00 | 102,11% | EUR | 102,11% | 6.030,12 | 3.171.316,12 | 3,3% |
| SAUDACOR, FRN, 28/06/2023, CORP | 3.300.000,00 | 103,39% | EUR | 103,39% | 467,50 | 3.412.469,50 | 3,6% |
| 1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E. | | | | | 353.467,04 | 28.739.208,20 | 30,3% |
| 1.2.1. Títulos De Dívida Pública | | | | | 311.676,23 | 25.732.278,23 | 27,1% |
| MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT | 2.000.000,00 | 112,45% | EUR | 112,45% | 21.090,14 | 2.270.090,14 | 2,4% |
| SPGB, 4.4%, 31/10/2023, GOVT | 17.000.000,00 | 114,14% | EUR | 114,14% | 125.008,22 | 19.528.128,22 | 20,6% |
| SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT | 3.350.000,00 | 112,49% | EUR | 112,49% | 165.577,87 | 3.934.059,87 | 4,1% |
| 1.2.3. Obrigações Diversas | | | | | 41.790,81 | 3.006.929,97 | 3,2% |
| ARCELORMITTAL, 2.25%, 17/01/2024, CORP, CALL | 1.000.000,00 | 104,12% | EUR | 104,12% | 21.454,92 | 1.062.674,92 | 1,1% |
| DRAX, 6.625%, 01/11/2025, CORP, USD, CALL, 144A | 2.260.000,00 | 104,46% | USD | 85,13% | 20.335,89 | 1.944.255,05 | 2,0% |
| 1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E. | | | | | 78.969,67 | 11.712.380,16 | 12,3% |
| 1.3.3. Obrigações Diversas | | | | | 78.969,67 | 11.712.380,16 | 12,3% |
| ALIBABA, 3.6%, 28/11/2024, CORP, USD, CALL | 1.300.000,00 | 109,50% | USD | 89,23% | 3.496,05 | 1.163.495,24 | 1,2% |
| ATHENE GLOBAL FUNDING, 1.875%, 23/06/2023, CORP | 400.000,00 | 104,45% | EUR | 104,45% | 3.924,66 | 421.724,66 | 0,4% |
| GUOTAI JUNAN, FRN, 12/03/2022, CORP | 2.000.000,00 | 99,39% | EUR | 99,39% | 637,56 | 1.988.337,56 | 2,1% |
| ICBCIL FIN, 3.375%, 05/04/2022, CORP, USD | 300.000,00 | 102,53% | USD | 83,55% | 1.971,11 | 252.623,05 | 0,3% |
| MPT OPER, 5%, 15/10/2027, CORP, USD, CALL | 2.650.000,00 | 105,24% | USD | 85,76% | 22.795,39 | 2.295.411,72 | 2,4% |
| OPEN TEXT, 5.875%, 01/06/2026, CORP, USD, CALL, 144A | 3.000.000,00 | 102,60% | USD | 83,61% | 11.969,28 | 2.520.322,31 | 2,7% |
| TRICERATOPS CAPITAL, 0.817%, 25/01/2021, CORP | 2.000.000,00 | 99,97% | EUR | 99,97% | 15.268,52 | 2.014.568,52 | 2,1% |
| WP CAREY, 2%, 20/01/2023, CORP, CALL | 1.000.000,00 | 103,70% | EUR | 103,70% | 18.907,10 | 1.055.897,10 | 1,1% |
| 2. Valores Não Cotados | | | | | 0,00 | 2.000.000,00 | 10,8% |
| 2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros | | | | | 0,00 | 2.000.000,00 | 10,8% |
| 2.2.4. Acções | | | | | | 2.000.000,00 | 2,1% |
| FID LOANS 1 (IRELAND) LIMITED | 2.000.000,00 | 1,00 | EUR | 1,00 | | 2.000.000,00 | 2,1% |
| 5. Liquidez | | | | | | 288.092,17 | 0,3% |
| 5.1. À Vista | | | | | | 288.092,17 | 0,3% |
| Depósitos à Ordem | | | | | | 288.092,17 | 0,3% |
| 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 MAR21 | 67,00 | 0,00 | USD | 0,00 | | 0,00 | 0,0% |
| 9. Outros Activos | | | | | | 47.444,34 | 0,1% |
| 9.1. Outros Devedores E Credores | | | | | | 47.444,34 | 0,1% |
| Juros de D.O. a Regularizar | | | | | | 0,01 | 0,0% |
| Impostos a Regularizar | | | | | | 47.444,33 | 0,1% |

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.