

LEVE DUO

31 março 2020

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 31/03/2020, 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					6.575.379,56	924.263.959,04	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					6.527.544,78	691.265.426,09	74,8%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					2.449.527,75	130.333.372,43	14,1%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					2.349.681,18	113.510.378,48	12,3%
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	110,49%	EUR	110,49%	46.352,47	3.361.022,47	0,4%
PGB, 2.2%, 17/10/2022, GOVT	31.000.000,00	105,74%	EUR	105,74%	309.322,46	33.089.652,46	3,6%
PGB, 2.875%, 15/10/2025, GOVT	7.382,78	113,52%	EUR	113,52%	97,43	8.478,73	0,0%
PGB, 3.85%, 15/04/2021, GOVT	10.000.000,00	104,28%	EUR	104,28%	369.221,46	10.796.921,46	1,2%
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	31.000.000,00	124,54%	EUR	124,54%	1.229.835,87	39.837.545,87	4,3%
PGB, 4.8%, 15/06/2020, GOVT	5.400.000,00	101,02%	EUR	101,02%	205.376,99	5.660.672,99	0,6%
PGB, 4.95%, 25/10/2023, GOVT	4.000.000,00	117,34%	EUR	117,34%	85.475,41	4.779.235,41	0,5%
PGB, 5.65%, 15/02/2024, GOVT	5.000.000,00	121,23%	EUR	121,23%	34.733,61	6.096.383,61	0,7%
REGIAO AUTONOMA Acores, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	98,11%	EUR	98,11%	69.265,48	9.880.465,48	1,1%
1.1.3. Obrigações Diversas					99.846,57	16.782.737,57	1,8%
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP	9.000.000,00	107,54%	EUR	107,54%	41.286,57	9.719.526,57	1,1%
SAUDACOR, FRN, 15/07/2020, CORP	1.970.000,00	99,56%	EUR	99,56%	11.129,18	1.972.421,78	0,2%
SAUDACOR, FRN, 20/06/2022, CORP	3.430.000,00	102,49%	EUR	102,49%	34.014,16	3.549.352,56	0,4%
SAUDACOR, FRN, 29/06/2021, CORP	1.500.000,00	101,87%	EUR	101,87%	13.416,66	1.541.436,66	0,2%
1.1.4. Acções						40.256,38	0,0%
BES, PL	99.815,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
CTT, PL	2.714,00	2,28	EUR	2,28		6.198,78	0,0%
REN, PL	14.680,00	2,32	EUR	2,32		34.057,60	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					2.110.811,92	362.165.083,06	39,2%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					1.870.066,75	327.984.543,65	35,5%
BTPS, 0.05%, 15/04/2021, GOVT	67.500.000,00	99,83%	EUR	99,83%	15.491,57	67.402.766,57	7,3%
BTPS, 0.2%, 15/10/2020, GOVT	30.000.000,00	100,01%	EUR	100,01%	27.541,08	30.031.741,08	3,2%
BTPS, 0.35%, 15/06/2020, GOVT	40.000.000,00	100,04%	EUR	100,04%	40.928,78	40.056.928,78	4,3%
BTPS, 2.45%, 01/10/2023, GOVT	9.000.000,00	106,13%	EUR	106,13%	109.647,56	9.661.077,56	1,0%
BTPS, 2.5%, 01/12/2024, GOVT	5.000.000,00	107,21%	EUR	107,21%	41.325,13	5.401.875,13	0,6%
BTPS, 3.75%, 01/05/2021, GOVT	7.500.000,00	103,78%	EUR	103,78%	116.672,42	7.900.397,42	0,9%
BTPS, 3.75%, 01/08/2021, GOVT	400.000,00	104,56%	EUR	104,56%	2.431,32	420.687,32	0,0%
BTPS, 3.75%, 01/09/2024, GOVT	1.500.000,00	112,43%	EUR	112,43%	4.623,29	1.691.058,29	0,2%
BTPS, 4%, 01/09/2020, GOVT	10.000.000,00	101,59%	EUR	101,59%	32.876,70	10.191.576,70	1,1%
BTPS, 4.5%, 01/05/2023, GOVT	8.200.000,00	111,91%	EUR	111,91%	152.237,68	9.328.939,68	1,0%
BTPS, 4.75%, 01/08/2023, GOVT	32.300.000,00	113,59%	EUR	113,59%	248.683,37	36.937.607,37	4,0%
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	103,71%	EUR	103,71%	111.475,41	20.853.075,41	2,3%
SPGB, 1.15%, 30/07/2020, GOVT	9.650.000,00	100,47%	EUR	100,47%	74.286,54	9.769.159,04	1,1%
SPGB, 2.75%, 31/10/2024, GOVT	28.900.000,00	111,71%	EUR	111,71%	330.060,11	32.613.094,11	3,5%
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	20.000.000,00	138,58%	EUR	138,58%	427.759,56	28.144.559,56	3,0%
SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT	15.140.000,00	115,23%	EUR	115,23%	134.026,23	17.579.999,63	1,9%
1.2.3. Obrigações Diversas					240.745,17	34.180.539,41	3,7%
BANCO SABADELL, 6.25%, 26/04/2020, CORP	450.000,00	99,78%	EUR	99,78%	26.093,75	475.090,25	0,1%
CRITERIA CAIXA, 1.375%, 10/04/2024, CORP	2.000.000,00	96,92%	EUR	96,92%	26.801,71	1.965.221,71	0,2%
EP INFRASTRUCTURE, 1.659%, 26/04/2024, CORP, CALL	4.000.000,00	98,32%	EUR	98,32%	61.645,90	3.994.245,90	0,4%
IGT, 4.75%, 15/02/2023, CORP, CALL	9.535.000,00	79,68%	EUR	79,68%	57.872,15	7.655.264,80	0,8%
INT CONSOLIDATED AIRLINE, 0.625%, 17/11/2022, CONV	17.600.000,00	79,92%	EUR	79,92%	40.601,09	14.107.049,09	1,5%
INTL CONSOL AIRLINES, 0.5%, 04/07/2023, CORP, CALL	7.000.000,00	73,54%	EUR	73,54%	25.915,30	5.173.715,30	0,6%
LADBROKES GROUP, 5.125%, 16/09/2022, CORP, GBP	764.000,00	93,76%	GBP	105,78%	1.815,27	809.952,36	0,1%

Designação		Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
1.3.3.	Obrigações Diversas					1.967.205,11	196.571.163,90	21,3%
	AMC NETWORKS, 5%, 01/04/2024, CORP, USD, CALL	1.298.000,00	96,76%	USD	88,32%	29.453,92	1.175.783,64	0,1%
	AMERICA MOVIL, CZ, 28/05/2020, CORP, CONV	32.340.000,00	98,92%	EUR	98,92%	0,00	31.990.081,20	3,5%
	AMERICAN AIRLINES, 4.375%, 01/10/2022 (EXT DT 2024) CORP, SINK, USD	9.535.730,86	89,98%	USD	82,13%	190.392,58	8.021.685,53	0,9%
	AMERICAN AIRLINES, 4.4%, 22/09/2023 (EXT DT 2025) CORP, SINK, USD	3.838.032,22	81,84%	USD	74,70%	3.853,45	2.870.712,18	0,3%
	AMG CAPITAL TRUST, SUB, 5.15%, 15/10/2037, USD, CONV	203.200,00	35,00%	USD	31,95%	100.823,09	6.592.243,32	0,7%
	ARES CAPITAL, 3.75%, 01/02/2022, CORP, USD, CONV, 144A	4.600.000,00	88,49%	USD	80,76%	26.241,33	3.741.383,72	0,4%
	BANK OF CHINA HK, 0%, 13/11/2021, CORP	10.000.000,00	100,01%	EUR	100,01%	0,00	10.001.000,00	1,1%
	BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	11.500.000,00	98,47%	USD	89,87%	218.131,05	10.553.645,84	1,1%
	BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL	400.000,00	104,74%	EUR	104,74%	376,99	419.340,99	0,0%
	CENTRAL PLAZA, 3.875%, 30/01/2021, CORP, USD	3.900.000,00	98,89%	USD	90,26%	22.989,69	3.543.170,41	0,4%
	CGNPC INTERNATIONAL LTD, 2%, 11/09/2025, CORP	2.000.000,00	105,98%	EUR	105,98%	22.094,93	2.141.714,93	0,2%
	CHINA CINDA FINANCE 2017, 4.1%, 09/03/2024, CORP, USD	10.000.000,00	105,54%	USD	96,33%	22.869,26	9.655.764,48	1,0%
	CIFI, 6.875%, 23/04/2021, CORP, USD, CALL	250.000,00	98,36%	USD	89,78%	6.885,18	231.332,97	0,0%
	CNOOC CURTIS FUND, 4.5%, 03/10/2023, CORP, USD	4.000.000,00	107,20%	USD	97,84%	81.234,03	3.994.998,18	0,4%
	CNOOC FINANCE 2015, 3.5%, 05/05/2025, CORP, USD	5.000.000,00	105,48%	USD	96,28%	64.779,32	4.878.671,25	0,5%
	COLONY NORTHSTAR, 3.875%, 15/01/2021, CORP, USD, CONV	29.478.000,00	74,89%	USD	68,35%	220.104,44	20.368.516,54	2,2%
	COLONY NORTHSTAR, 5%, 15/04/2023, CORP, USD, CONV	19.000.000,00	82,00%	USD	74,84%	399.831,65	14.620.350,09	1,6%
	CONTL AIRLINES, 6.25%, 11/04/2020 (EXT DT 2021) CORP, SINK, USD	2.456.692,37	99,58%	USD	90,89%	66.179,76	2.298.998,31	0,2%
	CSSC CAPITAL, 1.75%, 27/09/2023, CORP	8.300.000,00	101,93%	EUR	101,93%	73.815,57	8.534.254,57	0,9%
	EBAY, 3.45%, 01/08/2024, CORP, USD, CALL	5.000.000,00	101,23%	USD	92,40%	26.241,33	4.646.175,61	0,5%
	FRESNILLO, 5.5%, 13/11/2023, CORP, USD	333.000,00	97,95%	USD	89,41%	6.408,13	304.129,46	0,0%
	HAITONG SECURITIES, FRN, 13/12/2023, CORP	2.200.000,00	98,39%	EUR	98,39%	1.294,70	2.165.808,70	0,2%
	MOMO INC, 1.25%, 01/07/2025, CORP, USD, 144A, CONV, PUT	6.000.000,00	77,76%	USD	70,97%	17.113,91	4.275.383,35	0,5%
	NATIONAL GRID, 0.9%, 02/11/2020, GBP, CONV	6.000.000,00	98,48%	GBP	111,10%	24.633,72	6.690.405,41	0,7%
	PHILIP MORRIS, 0.625%, 08/11/2024, CORP, CALL	3.700.000,00	96,15%	EUR	96,15%	9.098,36	3.566.685,36	0,4%
	TALENT YIELD EURO, 1.435%, 07/05/2020, CORP	3.400.000,00	99,85%	EUR	99,85%	43.857,68	3.438.621,68	0,4%
	UAL 2007, 6.636%, 02/07/2022 (EXT DT 2024), CORP, SINK, USD	777.922,32	96,27%	USD	87,87%	11.648,71	695.178,01	0,1%
	VALE SA, 3.75%, 10/01/2023, CORP	3.000.000,00	97,41%	EUR	97,41%	24.897,54	2.947.167,54	0,3%
	VEREIT INC, 3.75%, 15/12/2020, CORP, USD, CONV	25.000.000,00	96,22%	USD	87,82%	251.954,79	22.207.960,63	2,4%
1.3.4.	Acções						2.195.806,70	0,2%
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL, HK, HKD	5.884.000,00	3,17	HKD	0,37		2.195.806,70	0,2%
3.	Unidades de Participação de Instituições de Investimento Colectivo						52.901.275,00	5,7%
3.1.	Fundos Harmonizados					0,00	52.901.275,00	5,7%
	ISHARES CORE EURO CORP BOND (FIM)	345.000,00	125,60	EUR	125,60		43.332.000,00	4,7%
	ISHARES EUR CORP BBB-BB (FIM)	1.970.000,00	4,86	EUR	4,86		9.569.275,00	1,0%
5.	Líquidez					0,00	180.012.610,95	19,5%
5.1.	À Vista						31.964.776,17	3,5%
	Depósitos à Ordem						31.964.776,17	3,5%
5.2.	A Prazo					47.834,78	148.047.834,78	16,0%
	Depósitos e Outros Equiparados					47.834,78	148.047.834,78	16,0%
7.	Operações Com Produtos Derivados					0,00	0,00	0,0%
7.1.	Em Mercado Regulamentado						0,00	0,0%
7.1.1.	Futuros						0,00	0,0%
	EURGBP FX CURR FUT JUN20	60,00	0,00	GBP	0,00		0,00	0,0%
	EURUSD FX CURR FUT JUN20	1.023,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9.	Outros Activos						84.647,00	0,0%
9.1.	Devedores e Credores Diversos						84.647,00	0,0%
	Juros de D.O. a Regularizar						0,19	0,0%
	Impostos a Regularizar						84.646,81	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.