

## LEVE TRI

28 fevereiro 2021

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 com referência a 28/02/2021, 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>3.505,97</b>	<b>5.059.690,88</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>3.505,97</b>	<b>3.173.250,16</b>	<b>62,7%</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	22.523,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>3.505,97</b>	<b>3.021.332,27</b>	<b>59,7%</b>
<b>1.2.1. Títulos da Dívida Pública</b>					<b>3.505,97</b>	<b>821.666,06</b>	<b>16,2%</b>
BKO, 0%, 10/09/2021, GOVT	139.000,00	100,32%	EUR	100,32%	0,00	139.440,63	2,8%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	40.000,00	108,86%	EUR	108,86%	195,60	43.740,40	0,9%
BTPS, 3,45%, 01/03/2048, GOVT	44.000,00	140,12%	EUR	140,12%	748,60	62.403,16	1,2%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	30.000,00	140,12%	EUR	140,12%	88,77	42.123,57	0,8%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	34.000,00	105,19%	EUR	105,19%	3,03	35.766,27	0,7%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	5.000,00	106,50%	EUR	106,50%	13,48	5.338,38	0,1%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	100,82%	EUR	100,82%	0,00	36.296,64	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	135.000,00	103,47%	EUR	103,47%	87,84	139.773,69	2,8%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	75.000,00	112,99%	EUR	112,99%	1.100,34	85.841,34	1,7%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	15.000,00	100,87%	EUR	100,87%	0,00	15.131,10	0,3%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	125.000,00	101,51%	EUR	101,51%	184,93	127.073,68	2,5%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	47.000,00	114,89%	EUR	114,89%	534,83	54.531,25	1,1%
SPGB, 4.7%, 30/07/2041, GOVT	20.000,00	168,29%	EUR	168,29%	548,55	34.205,95	0,7%
<b>1.2.4. Acções</b>						<b>2.199.666,21</b>	<b>43,5%</b>
ADIDAS, GY	132,00	289,20	EUR	289,20		38.174,40	0,8%
ADYEN NV, NA	7,00	1.916,50	EUR	1.916,50		13.415,50	0,3%
AIR LIQUIDE, FP	330,00	124,55	EUR	124,55		41.101,50	0,8%
AIRBUS GROUP, FP	594,00	95,80	EUR	95,80		56.905,20	1,1%
AKZO NOBEL, NA	235,00	85,78	EUR	85,78		20.158,30	0,4%
ALLIANZ, GY	156,00	199,90	EUR	199,90		31.184,40	0,6%
ANHEUSER-BUSCH INBEV, BB	682,00	47,46	EUR	47,46		32.367,72	0,6%
ASML HOLDING, NA	354,00	469,05	EUR	469,05		166.043,70	3,3%
AXA, FP	587,00	20,76	EUR	20,76		12.186,12	0,2%
BANCO SANTANDER, SM	17.195,00	2,89	EUR	2,89		49.702,16	1,0%
BASF, GY	602,00	67,69	EUR	67,69		40.749,38	0,8%
BAYER, GY	1.203,00	50,29	EUR	50,29		60.498,87	1,2%
BMW, GY	571,00	71,31	EUR	71,31		40.718,01	0,8%
BNP PARIBAS, FP	1.228,00	49,34	EUR	49,34		60.583,38	1,2%
BOUYGUES, FP	419,00	33,68	EUR	33,68		14.111,92	0,3%
CREDIT AGRICOLE, FP	2.953,00	11,66	EUR	11,66		34.431,98	0,7%
CRH, ID	594,00	35,66	EUR	35,66		21.182,04	0,4%
DAIMLER, GY	396,00	66,23	EUR	66,23		26.227,08	0,5%
DANONE, FP	542,00	56,74	EUR	56,74		30.753,08	0,6%
DASSAULT, FP	155,00	172,20	EUR	172,20		26.691,00	0,5%
DEUTSCHE BANK, GY	3.616,00	10,28	EUR	10,28		37.172,48	0,7%
DEUTSCHE POST, GY	1.499,00	41,14	EUR	41,14		61.668,86	1,2%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	3.512,00	14,99	EUR	14,99		52.644,88	1,0%
DSM, NA	176,00	136,85	EUR	136,85		24.085,60	0,5%
ENEL, IM	4.824,00	7,84	EUR	7,84		37.800,86	0,7%
ENI SPA, IM	1.063,00	9,47	EUR	9,47		10.062,36	0,2%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	1.228,00	27,10	EUR	27,10		33.278,80	0,7%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	209,00	134,40	EUR	134,40		28.089,60	0,6%
ESSITY AB, SS, SEK	656,00	255,90	SEK	25,24		16.557,23	0,3%
FERROVIAL, SM	458,00	20,74	EUR	20,74		9.498,92	0,2%
FRESENIUS, GY	491,00	35,32	EUR	35,32		17.342,12	0,3%
HERMES, FP	22,00	924,00	EUR	924,00		20.328,00	0,4%
IBERDROLA, SM	3.551,00	10,46	EUR	10,46		37.143,46	0,7%
ILIAD, FP	150,00	146,75	EUR	146,75		22.012,50	0,4%
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA, SM	1.205,00	27,26	EUR	27,26		32.848,30	0,6%
INFINEON, GY	268,00	36,02	EUR	36,02		9.653,36	0,2%
IRISH BANK RESOLUTION, ID	446,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
KBC GROUP NV, BB	675,00	59,66	EUR	59,66		40.270,50	0,8%
KERING, FP	60,00	524,70	EUR	524,70		31.482,00	0,6%
L' OREAL, FP	251,00	303,50	EUR	303,50		76.178,50	1,5%
LVMH, FP	230,00	525,00	EUR	525,00		120.750,00	2,4%
MICHELIN, FP	127,00	119,80	EUR	119,80		15.214,60	0,3%
NESTE OYJ, FH	285,00	54,50	EUR	54,50		15.532,50	0,3%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
PERNOD-RICARD, FP	251,00	157,60	EUR	157,60		39.557,60	0,8%
PROSUS NV, NA	384,00	97,90	EUR	97,90		37.593,60	0,7%
REPSOL, SM	1.001,00	10,50	EUR	10,50		10.505,50	0,2%
RWE, GY	302,00	31,52	EUR	31,52		9.519,04	0,2%
SAFRAN, FP	128,00	112,75	EUR	112,75		14.432,00	0,3%
SAMPO OYJ, FH	1.164,00	36,95	EUR	36,95		43.009,80	0,9%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	764,00	76,08	EUR	76,08		58.125,12	1,1%
SAP, GY	473,00	102,18	EUR	102,18		48.331,14	1,0%
SCHNEIDER, FP	212,00	123,25	EUR	123,25		26.129,00	0,5%
SIEMENS ENERGY AG, GY	396,00	31,14	EUR	31,14		12.331,44	0,2%
SIEMENS HEALTHINEERS, GY	483,00	45,81	EUR	45,81		22.123,82	0,4%
SIEMENS, GY	793,00	128,34	EUR	128,34		101.773,62	2,0%
ST.GOBAIN, FP	655,00	44,36	EUR	44,36		29.055,80	0,6%
TELECOM ITALIA, IM	34.217,00	0,39	EUR	0,39		13.491,76	0,3%
TELEFONICA, SM	2.906,00	3,55	EUR	3,55		10.313,39	0,2%
TELEPERFORMANCE, FP	57,00	292,10	EUR	292,10		16.649,70	0,3%
TOTAL FINA, FP	1.882,00	38,50	EUR	38,50		72.457,01	1,4%
UNICREDIT, IM	3.410,00	8,49	EUR	8,49		28.961,13	0,6%
VINCI, FP	447,00	86,14	EUR	86,14		38.504,58	0,8%
<b>1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.</b>					<b>0,00</b>	<b>151.917,89</b>	<b>3,0%</b>
<b>1.3.4. Acções</b>					<b>0,00</b>	<b>151.917,89</b>	<b>3,0%</b>
ANGLO AMERICAN, LN, GBP	576,00	27,92	GBP	32,07		18.470,40	0,4%
OCADO, LN, GBP	833,00	22,09	GBP	25,38		21.137,67	0,4%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	241,00	59,98	GBP	68,90		16.605,03	0,3%
STELLANTIS NV, IM	3.608,00	13,48	EUR	13,48		48.635,84	1,0%
STMICROELECTRONICS, FP	1.000,00	32,17	EUR	32,17		32.170,00	0,6%
ZURICH INSURANCE GROUP, VX, CHF	44,00	372,00	CHF	338,61		14.898,96	0,3%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>					<b>0,00</b>	<b>1.221.558,65</b>	<b>24,1%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>					<b>0,00</b>	<b>1.221.558,65</b>	<b>24,1%</b>
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	1.223,00	223,32	EUR	223,32		273.120,36	5,4%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	1.928,00	140,12	EUR	140,12		270.151,36	5,3%
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM)	2.010,00	40,95	EUR	40,95		82.309,50	1,6%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM)	653,00	83,56	EUR	83,56		54.564,68	1,1%
ISHARES USD CORP BND EUR-H D (FIM)	23.422,00	5,02	EUR	5,02		117.531,60	2,3%
NORDEA 1 EUR HGH YLD-BI-EUR	3.817,00	39,56	EUR	39,56		151.000,52	3,0%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	1.529,00	178,47	EUR	178,47		272.880,63	5,4%
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>1.722,12</b>	<b>0,0%</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>1.722,12</b>	<b>0,0%</b>
CAIXAGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	424,00	4,06	EUR	4,06		1.722,12	0,0%
<b>5. Líquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>660.114,06</b>	<b>13,0%</b>
<b>5.1. À Vista</b>					<b>0,00</b>	<b>660.114,06</b>	<b>13,0%</b>
Depósitos à Ordem					0,00	660.114,06	13,0%
<b>9. Outros Activos</b>					<b>0,00</b>	<b>3.045,88</b>	<b>0,1%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>					<b>0,00</b>	<b>3.045,88</b>	<b>0,1%</b>
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	0,11	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	43,41	0,0%
Impostos a Regularizar					0,00	9.835,13	0,2%
Comissões					0,00	-6.832,77	-0,1%
<b>VALOR TOTAL DA CARTEIRA</b>						<b>5.059.690,88</b>	
<b>NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>918.380,32</b>	
<b>VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO</b>						<b>5,50936</b>	

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.

<b>Ano</b>	<b>Rendibilidade</b>	<b>Volatilidade</b>	<b>Rend. Anualizada</b>	
<b>2008</b>	-21,35%	14,29%	<b>1 Ano</b>	1,55%
<b>2009</b>	12,13%	10,39%	<b>3 Anos</b>	0,62%
<b>2010</b>	-1,04%	11,06%	<b>5 Anos</b>	0,30%
<b>2011</b>	-7,30%	13,27%	<b>Desde o Início</b>	0,64%
<b>2012</b>	11,06%	7,83%		
<b>2013</b>	10,76%	7,91%		
<b>2014</b>	1,18%	9,63%		
<b>2015</b>	6,19%	11,04%		
<b>2016</b>	-1,84%	10,08%		
<b>2017</b>	1,51%	5,45%		
<b>2018</b>	-9,19%	8,20%		
<b>2019</b>	10,48%	5,98%		
<b>2020</b>	1,55%	16,87%		

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