

LEVE DUO

31 março 2025

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 30 junho 2024, 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						4.709.085,43	319.213.866,55	100,0%
1.	Valores Mobiliários Cotados					4.709.085,43	314.289.264,98	98,5%
1.1.	Mercado Cotações Oficiais Portugal					982.352,38	40.271.752,38	12,6%
1.1.1.	Títulos De Dívida Pública					982.352,38	40.271.752,38	12,6%
	PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	98,22%	EUR	98,22%	46.319,21	2.992.769,21	0,9%
	PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT	5.000.000,00	106,30%	EUR	106,30%	23.356,17	5.338.306,17	1,7%
	PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	21.000.000,00	104,02%	EUR	104,02%	833.023,98	22.677.223,98	7,1%
	REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	91,84%	EUR	91,84%	79.653,02	9.263.453,02	2,9%
1.2.	Mercado Cotações Oficiais U.E.					3.004.876,90	210.245.460,84	65,9%
1.2.1.	Títulos De Dívida Pública					2.867.281,75	190.033.206,35	59,5%
	BTPS, 0.35%, 17/11/2028, GOVT	2.000.000,00	93,38%	EUR	93,38%	4.441,99	1.872.101,99	0,6%
	BTPS, 2.65%, 01/12/2027, GOVT	5.000.000,00	100,74%	EUR	100,74%	43.681,32	5.080.681,32	1,6%
	BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	14.000.000,00	107,20%	EUR	107,20%	54.211,96	15.061.511,96	4,7%
	BTPS, 5.25%, 01/11/29, GOVT	4.000.000,00	110,60%	EUR	110,60%	87.596,67	4.511.756,67	1,4%
	BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	14.000.000,00	110,40%	EUR	110,40%	377.071,80	15.832.511,80	5,0%
	JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, GOVT	1.590.000,00	94,71%	EUR	94,71%	20.344,27	1.526.296,87	0,5%
	JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	98,08%	EUR	98,08%	111.123,29	19.727.123,29	6,2%
	MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	900.000,00	95,83%	EUR	95,83%	12.976,89	875.473,89	0,3%
	SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	3.000.000,00	84,90%	EUR	84,90%	2.753,42	2.549.753,42	0,8%
	SPGB, 0.6%, 31/10/2029, GOVT	5.000.000,00	91,38%	EUR	91,38%	12.410,96	4.581.210,96	1,4%
	SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	24.500.000,00	109,18%	EUR	109,18%	521.984,25	27.269.859,25	8,5%
	SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT	30.000.000,00	117,94%	EUR	117,94%	1.153.150,68	36.533.950,68	11,4%
	SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	48.000.000,00	112,80%	EUR	112,80%	465.534,25	54.610.974,25	17,1%
1.2.3.	Obrigações Diversas					137.595,15	20.212.254,49	6,3%
	ACCOR, 2.375%, 29/11/2028, CORP, CALL	3.500.000,00	97,15%	EUR	97,15%	27.784,25	3.427.929,25	1,1%
	ALD, 4.25%, 18/01/2027, CORP	1.500.000,00	102,65%	EUR	102,65%	12.575,34	1.552.265,34	0,5%
	BANCO SANTANDER, VAR, 18/10/2027, CORP, CALL	2.000.000,00	102,63%	EUR	102,63%	41.561,64	2.094.061,64	0,7%
	BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP	2.600.000,00	96,25%	EUR	96,25%	2.706,85	2.505.310,85	0,8%
	CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0%, 25/05/2029, CORP	1.000.000,00	89,62%	EUR	89,62%	0,00	896.230,00	0,3%
	CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0,6%, 25/11/2029, CORP	1.000.000,00	90,76%	EUR	90,76%	2.071,23	909.681,23	0,3%
	CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 2.75%, 25/02/2029, CORP	2.000.000,00	100,38%	EUR	100,38%	5.123,29	2.012.803,29	0,6%
	CREDIT AGRICOLE, 2.7%, 15/07/2025, CORP	300.000,00	99,94%	EUR	99,94%	1.687,50	301.492,50	0,1%
	CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP	175.000,00	99,85%	EUR	99,85%	872,81	175.610,31	0,1%
	FORVIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	1.050.000,00	95,75%	EUR	95,75%	7.273,44	1.012.690,44	0,3%
	FRESENIUS, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	500.000,00	101,62%	EUR	101,62%	17.873,29	525.963,29	0,2%
	RYANAIR DAC, 0.875%, 25/05/2026, CORP	939.000,00	97,86%	EUR	97,86%	6.978,18	925.846,02	0,3%
	SECURITAS TREASURY IRELAND, 4.375%, 06/03/2029, CORP, CALL	3.700.000,00	104,36%	EUR	104,36%	11.087,33	3.872.370,33	1,2%
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					684.664,37	61.220.334,98	19,2%
1.3.1.	Títulos De Dívida Pública					37.191,78	2.551.716,78	0,8%
	BTPS, 3%, 01/10/2029, GOVT	2.500.000,00	100,58%	EUR	100,58%	37.191,78	2.551.716,78	0,8%
1.3.3.	Obrigações Diversas					684.664,37	61.220.334,98	19,2%
	ASHTREAD, 4%, 01/05/2028, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	97,06%	USD	97,06%	30.821,39	1.825.791,34	0,6%
	BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL	400.000,00	98,64%	EUR	98,64%	376,99	394.952,99	0,1%
	CANARY WHARF, 2.625%, 23/04/2025, CORP, GBP, CALL	4.300.000,00	99,35%	GBP	118,94%	59.022,82	5.173.302,89	1,6%
	CGNPC INTERNATIONAL LTD, 2%, 11/09/2025, CORP	2.000.000,00	99,45%	EUR	99,45%	22.027,40	2.010.927,40	0,6%
	DELTA AIR LINES, 4.5%, 20/10/2025, CORP, USD, SINK, 144A	499.125,00	99,70%	USD	92,19%	4.095,92	464.232,40	0,1%
	ENERGY TRANSFER, 4.2%, 15/04/2027, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	99,15%	USD	91,67%	35.814,47	1.869.304,99	0,6%
	ENERGY TRANSFER, 5.5%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL	1.800.000,00	101,54%	USD	93,89%	30.513,18	1.720.499,31	0,5%
	FREEPORT-MCMORAN, 4.125%, 01/03/2028, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	98,25%	USD	90,84%	3.178,46	911.601,94	0,3%
	IQVIA, 5%, 15/10/2026, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	99,27%	USD	91,79%	63.954,39	2.817.740,79	0,9%
	LITHIA MOTORS, 4.625%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL 144A	2.000.000,00	96,94%	USD	89,63%	25.183,64	1.817.860,48	0,6%
	MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL	3.000.000,00	100,36%	USD	92,80%	47.985,04	2.831.951,76	0,9%
	MEITUAN, 2.125%, 28/10/2025, CORP, USD, CALL	200.000,00	98,55%	USD	91,12%	1.670,13	183.909,61	0,1%
	OPEN TEXT, 6.9%, 01/12/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	103,51%	USD	95,71%	31.634,30	1.467.293,11	0,5%
	PINGAN REAL ESTATE, 3.25%, 23/06/2025, CORP, USD	30.000.000,00	99,00%	USD	91,54%	245.415,38	27.706.719,13	8,7%
	RADIAN GROUP, 4.875%, 15/03/2027, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	99,91%	USD	92,38%	2.003,39	925.840,65	0,3%
	SINOCHEM OFFSHORE, 1.625%, 29/10/2025, CORP, USD	1.000.000,00	98,31%	USD	90,90%	6.302,33	915.289,85	0,3%
	SMITHFIELD FOODS, 4.25%, 01/02/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.000.000,00	98,50%	USD	91,08%	6.549,55	917.358,60	0,3%
	TOWER BERSAMA, 2.75%, 20/01/2026, CORP, CALL, USD	1.800.000,00	97,55%	USD	90,20%	9.026,82	1.632.588,53	0,5%
	TRITON CONTAINER, 2.05%, 15/04/2026, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	96,94%	USD	89,63%	17.480,85	1.810.176,18	0,6%
	UNITED RENTALS, 4.875%, 15/01/2028, CORP, USD, CALL	2.500.000,00	98,43%	USD	91,01%	23.790,27	2.299.009,87	0,7%
	VISTRA OPERATIONS, 5.125%, 13/05/2025, CORP, USD, 144A	650.000,00	99,87%	USD	92,35%	11.807,48	612.055,29	0,2%
	ZHONGSHENG, 3%, 13/01/2026, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	97,97%	USD	90,59%	6.010,17	911.927,87	0,3%
2.	Valores Não Cotados					0,00	0,00	0,0%
2.1.	Valores Mobiliários Nacionais					0,00	0,00	0,0%
2.1.4.	Acções					0,00	0,00	0,0%
	BES, PL (EM LIQUIDACAO)					0,00	0,00	0,0%
3.	Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	6,42	0,0%
3.1.	Fundos Harmonizados					0,00	6,42	0,0%
	AXA WRLD EUR INF PLS-IEURACC (FIM)					0,00	6,42	0,0%
5.	Liquidez					0,00	-795.683,38	-0,2%
5.1.	À Vista					0,00	-795.683,38	-0,2%
	Depósitos à Ordem					0,00	-795.683,38	-0,2%
5.2.	A Prazo					0,00	931.435,03	0,3%
	Depósitos e Outros Equiparados					0,00	931.435,03	0,3%
7.	Operações Com Produtos Derivados					0,00	483.754,83	0,2%
7.1.	Em Mercado Regulamentado					0,00	483.754,83	0,2%
7.1.1.	Futuros					0,00	483.754,83	0,2%
	CMARGEM_FX_SG_JUN2025_GBP					0,00	-27.889,88	0,0%
	CMARGEM_FX_SG_JUN2025_USD					0,00	511.644,71	0,2%
	EURGBP FX CURR FUT JUN25					0,00	0,00	0,0%
	EURUSD FX CURR FUT JUN25					0,00	0,00	0,0%
7.2.	Fora De Mercado Regulamentado					0,00	0,00	0,0%
7.2.1.	Forwards					0,00	-12.048,05	0,0%
	FORWARD EUR vs GBP_NATWEST (1000000 GBP) (FW-EUR/GBP-18/03/2025-27	1,00	-10.064,46	GBP	-12.048,05	0,00	-12.048,05	0,0%
9.	Outros Activos					0,00	-2.946,57	0,0%
9.1.	Outros Devedores E Credores					0,00	-2.946,57	0,0%
	Juros de D.O. a Regularizar					0,00	-2.946,57	0,0%
9.1.2.	Outros Devedores E Credores					0,00	4.320.083,29	1,4%
	OPL-Alienações					0,00	4.320.083,29	1,4%

O património do Fundo será representado por investimentos, preferencialmente expressos em euros e no máximo de 10% em outras moedas, nos seguintes instrumentos:

- a) 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%;
- b) Imóveis ou fundos de investimento imobiliários e respectivos derivados numa percentagem máxima de 25%;
- c) 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;
- d) Operações de reporte e de empréstimo de valores, sem prejuízo do disposto nas alíneas anteriores.