

IB LEVE II

30 junho 2022

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 30 junho de 2022, 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					89.896,76	7.016.860,38	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					89.896,76	6.998.616,90	99,7%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					37.778,43	1.994.840,68	28,4%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					37.778,43	1.994.840,68	28,4%
PGB, 2.875%, 15/10/2025, GOVT	1.859.000,00	105,28%	EUR	105,28%	37.778,43	1.994.840,68	28,4%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					46.118,33	4.132.885,03	58,9%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					25.416,82	2.195.172,58	31,3%
BTPS, 0.95%, 01/03/2023, GOVT	400.000,00	100,36%	EUR	100,36%	1.249,46	402.689,46	5,7%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	900.000,00	120,67%	EUR	120,67%	9.538,04	1.095.568,04	15,6%
NETHERLANDS, 3.75%, 15/01/2023, GOVT	12.000,00	102,00%	EUR	102,00%	204,66	12.444,42	0,2%
SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT	650.000,00	103,08%	EUR	103,08%	14.424,66	684.470,66	9,8%
1.2.3. Obrigações Diversas					20.780,45	1.937.712,45	27,6%
EDP, 2.375%, 27/11/2023, CORP, CALL	1.400.000,00	100,22%	EUR	100,22%	19.585,62	1.422.707,62	20,3%
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	300.000,00	74,82%	EUR	74,82%	296,88	224.765,88	3,2%
NOKIA, 2.375%, 15/05/2025, CORP, CALL	300.000,00	96,45%	EUR	96,45%	897,95	290.238,95	4,1%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					5.921,06	870.891,19	12,4%
1.3.3. Obrigações Diversas					5.921,06	870.891,19	12,4%
AMERICAN AIRLINES, 3.7%, 01/05/2023 (EXT DT 2024) CORP, SINK, USD	124.975,72	96,86%	USD	93,25%	729,60	117.270,93	1,7%
BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	500.000,00	99,45%	USD	95,75%	4.680,00	483.417,84	6,9%
CENTENE CORP, 4.25%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL	300.000,00	93,38%	USD	89,90%	511,46	270.202,42	3,9%
5. Liquidez					0,00	14.826,22	0,2%
5.1. À Vista						14.826,22	0,2%
Depósitos à Ordem						14.826,22	0,2%
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 SET22	7,00	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.