

LEVE DUO

30 junho 2022

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 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					7.936.380,79	670.703.940,63	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					7.936.380,79	670.703.940,63	100,0%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					658.112,49	67.250.937,02	10,0%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					482.644,56	57.162.666,78	8,5%
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	100,48%	EUR	100,48%	2.404,11	3.016.864,11	0,4%
PGB, 2.875%, 15/10/2025, GOVT	7.382,78	105,27%	EUR	105,27%	150,03	7.922,25	0,0%
PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT	5.000.000,00	113,26%	EUR	113,26%	71.660,97	5.734.660,97	0,9%
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	31.000.000,00	111,76%	EUR	111,76%	269.763,70	34.914.433,70	5,2%
PGB, 4.95%, 25/10/2023, GOVT	4.000.000,00	105,39%	EUR	105,39%	134.531,51	4.350.251,51	0,6%
REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	91,34%	EUR	91,34%	4.134,24	9.138.534,24	1,4%
1.1.3. Obrigações Diversas					175.467,93	10.037.757,93	1,5%
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP	9.000.000,00	109,58%	EUR	109,58%	175.467,93	10.037.757,93	1,5%
1.1.4. Acções						50.512,31	0,0%
BES, PL	99.815,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
CTT, PL	2.714,00	3,12	EUR	3,12		8.454,11	0,0%
REN, PL	14.680,00	2,87	EUR	2,87		42.058,20	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					5.843.229,70	338.660.561,99	50,5%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					5.603.748,41	297.568.984,01	44,4%
BTPS, 0.35%, 17/11/2028, GOVT	2.000.000,00	88,03%	EUR	88,03%	836,96	1.761.476,96	0,3%
BTPS, 2.45%, 01/10/2023, GOVT	9.000.000,00	101,87%	EUR	101,87%	54.221,32	9.222.611,32	1,4%
BTPS, 2.5%, 01/12/2024, GOVT	5.000.000,00	102,07%	EUR	102,07%	9.904,37	5.113.554,37	0,8%
BTPS, 3.75%, 01/09/2024, GOVT	1.500.000,00	104,88%	EUR	104,88%	18.495,25	1.591.620,25	0,2%
BTPS, 4.5%, 01/05/2023, GOVT	8.200.000,00	103,26%	EUR	103,26%	60.163,04	8.527.319,04	1,3%
BTPS, 4.75%, 01/08/2023, GOVT	32.300.000,00	104,25%	EUR	104,25%	631.500,84	34.303.604,84	5,1%
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	14.000.000,00	111,70%	EUR	111,70%	218.654,91	15.856.654,91	2,4%
BTPS, 5.25%, 01/11/29, GOVT	4.000.000,00	116,41%	EUR	116,41%	34.809,77	4.691.169,77	0,7%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	14.000.000,00	120,67%	EUR	120,67%	148.369,54	17.042.169,54	2,5%
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	97,46%	EUR	97,46%	170.958,90	19.661.958,90	2,9%
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	900.000,00	96,79%	EUR	96,79%	2.362,96	873.436,96	0,1%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	3.000.000,00	82,92%	EUR	82,92%	501,37	2.488.101,37	0,4%
SPGB, 0.6%, 31/10/2029, GOVT	5.000.000,00	90,47%	EUR	90,47%	19.890,41	4.543.440,41	0,7%
SPGB, 2.75%, 31/10/2024, GOVT	28.900.000,00	103,92%	EUR	103,92%	526.930,14	30.558.654,14	4,6%
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	23.000.000,00	119,31%	EUR	119,31%	785.339,73	28.226.869,73	4,2%
SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT	15.140.000,00	103,08%	EUR	103,08%	335.983,56	15.942.901,16	2,4%
SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT	24.500.000,00	130,51%	EUR	130,51%	1.292.962,33	33.267.177,33	5,0%
SPGB, 5.9%, 30/07/2026, GOVT	2.000.000,00	117,33%	EUR	117,33%	108.301,37	2.454.941,37	0,4%
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	48.000.000,00	125,54%	EUR	125,54%	1.183.561,64	61.441.321,64	9,2%
1.2.3. Obrigações Diversas					239.481,29	41.091.577,98	6,1%
ACCOR, 2.375%, 29/11/2028, CORP, CALL	3.500.000,00	79,37%	EUR	79,37%	48.508,57	2.826.458,57	0,4%
BANCO SANTANDER, 1.125%, 23/06/2027, CORP	2.500.000,00	90,24%	EUR	90,24%	539,38	2.256.464,38	0,3%
BANCO SANTANDER, 3.25%, 04/04/2026, CORP	4.100.000,00	97,93%	EUR	97,93%	31.760,96	4.046.767,96	0,6%
BBVA, 0.375%, 02/10/2024, CORP	400.000,00	95,79%	EUR	95,79%	1.113,70	384.285,70	0,1%
BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP	2.600.000,00	88,41%	EUR	88,41%	5.947,95	2.304.607,95	0,3%
BNP PARIBAS, 2.875%, 01/10/2026, CORP	2.000.000,00	96,24%	EUR	96,24%	42.849,32	1.967.549,32	0,3%
CAIXABANK, 0.625%, 01/10/2024, CORP	5.000.000,00	95,04%	EUR	95,04%	23.287,67	4.775.237,67	0,7%
CAIXABANK, 1.75%, 24/10/2023, CORP	3.000.000,00	99,50%	EUR	99,50%	35.815,07	3.020.935,07	0,5%
CAIXABANK, 2.375%, 01/02/2024, CORP	600.000,00	100,26%	EUR	100,26%	5.817,12	607.353,12	0,1%
CARREFOUR SA, CZ, 14/06/2023, CORP, USD, CONV	8.400.000,00	96,12%	USD	92,54%	0,00	7.773.093,29	1,2%
CREDIT AGRICOLE, 2.7%, 15/07/2025, CORP	300.000,00	99,03%	EUR	99,03%	1.691,21	298.778,21	0,0%
CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP	175.000,00	96,88%	EUR	96,88%	876,92	170.420,42	0,0%
CRITERIA CAIXA, 1.375%, 10/04/2024, CORP	2.000.000,00	98,84%	EUR	98,84%	6.102,74	1.982.922,74	0,3%
EP INFRASTRUCTURE, 1.659%, 26/04/2024, CORP, CALL	4.000.000,00	84,55%	EUR	84,55%	11.817,53	3.393.937,53	0,5%
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	1.050.000,00	74,82%	EUR	74,82%	1.039,06	786.680,56	0,1%
JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, GOVT	1.590.000,00	94,95%	EUR	94,95%	3.704,48	1.513.345,88	0,2%
NOKIA, 2.375%, 15/05/2025, CORP, CALL	1.000.000,00	96,45%	EUR	96,45%	2.993,15	967.463,15	0,1%
SAMPO OYJ, 1%, 18/09/2023, CORP	2.000.000,00	99,98%	EUR	99,98%	15.616,46	2.015.276,46	0,3%

Designação		Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.						1.435.038,60	199.296.775,74	29,7%
1.3.3. Obrigações Diversas						1.435.038,60	197.260.664,66	29,4%
ALEXANDER FUND, 1.841%, 15/11/2023, CORP, USD, CALL, 144A		5.000.000,00	95,47%	USD	91,91%	11.077,55	4.606.629,68	0,7%
AMC NETWORKS, 5%, 01/04/2024, CORP, USD, CALL		513.261,00	97,11%	USD	93,49%	6.108,09	485.975,25	0,1%
AMERICAN AIRLINES, 4.375%, 01/10/2022 (EXT DT 2024) CORP, SINK, USD		6.006.337,13	99,24%	USD	95,54%	62.543,93	5.800.975,40	0,9%
AMERICAN AIRLINES, 4.4%, 22/09/2023 (EXT DT 2025) CORP, SINK, USD		3.291.441,44	94,32%	USD	90,81%	37.955,28	3.026.902,25	0,5%
ASHTREAD, 4%, 01/05/2028, CORP, USD, CALL, 144A		2.000.000,00	89,99%	USD	86,63%	12.622,62	1.745.269,20	0,3%
BARCLAYS, 3%, 08/05/2026, CORP, GBP		2.000.000,00	94,49%	GBP	110,10%	10.151,87	2.212.249,29	0,3%
BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD		11.500.000,00	99,45%	USD	95,75%	107.639,89	11.118.610,33	1,7%
BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL		400.000,00	97,32%	EUR	97,32%	2.521,10	391.805,10	0,1%
BOEING CO, 4.875%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL		2.000.000,00	99,63%	USD	95,91%	15.383,81	1.933.666,28	0,3%
CANARY WHARF, 2.625%, 23/04/2025, CORP, GBP, CALL		4.300.000,00	92,62%	GBP	107,92%	24.436,39	4.665.149,51	0,7%
CDK GLOBAL, 4.875%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL		1.000.000,00	99,13%	USD	95,44%	3.780,77	958.156,42	0,1%
CGNPC INTERN, 3.75%, 11/12/2027, CORP, USD		4.464.000,00	98,22%	USD	94,56%	8.505,83	4.229.686,93	0,6%
CGNPC INTERNATIONAL LTD, 2%, 11/09/2025, CORP		2.000.000,00	97,35%	EUR	97,35%	32.000,00	1.979.040,00	0,3%
CHINA CINDA FINANCE 2017, 4.1%, 09/03/2024, CORP, USD		10.000.000,00	99,74%	USD	96,02%	121.706,62	9.723.997,94	1,4%
CHN CLEAN ENERGY DEVELOP, 4%, 05/11/2025, CORP, USD		1.450.000,00	99,88%	USD	96,16%	8.530,96	1.402.873,41	0,2%
CNAC HK, 3.5%, 19/07/2022, CORP, USD		2.000.000,00	100,01%	USD	96,28%	30.139,16	1.955.796,23	0,3%
CNOOC CURTIS FUND, 4.5%, 03/10/2023, CORP, USD		4.000.000,00	101,48%	USD	97,70%	41.879,27	3.949.725,61	0,6%
COLONY NORTHSTAR, 5%, 15/04/2023, CORP, USD, CONV		8.000.000,00	98,26%	USD	94,59%	80.228,49	7.647.764,83	1,1%
CORNWALL JERSEY, 0.75%, 16/04/2026, CORP, GBP, CALL, CONV		1.500.000,00	64,96%	GBP	75,69%	2.686,24	1.138.103,39	0,2%
CSSC CAPITAL, 1.75%, 27/09/2023, CORP		8.300.000,00	97,95%	EUR	97,95%	109.832,88	8.239.667,88	1,2%
DRAX, 6.625%, 01/11/2025, CORP, USD, CALL, 144A		1.500.000,00	99,65%	USD	95,93%	15.679,66	1.454.665,89	0,2%
EBAY, 3.45%, 01/08/2024, CORP, USD, CALL		5.000.000,00	98,99%	USD	95,30%	68.735,76	4.833.874,87	0,7%
ENERGY TRANSFER OPER, 5.5%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL		1.800.000,00	101,48%	USD	97,70%	7.677,87	1.786.330,03	0,3%
ENERGY TRANSFER, 4.2%, 15/04/2027, CORP, USD, CALL		2.000.000,00	96,11%	USD	92,53%	16.847,99	1.867.449,71	0,3%
FREEPORT-MCMORAN INC, 4.125%, 01/03/2028, CORP, USD, CALL		1.000.000,00	92,81%	USD	89,35%	13.127,39	906.667,39	0,1%
FRESNILLO, 5.5%, 13/11/2023, CORP, USD		333.000,00	101,54%	USD	97,75%	2.302,04	327.816,19	0,0%
FUQING INV, 3.25%, 23/06/2025, CORP, USD		30.000.000,00	89,36%	USD	86,03%	18.251,99	25.827.147,72	3,9%
HAITONG INTL SECURITIES, 2.125%, 02/07/2023, CORP, USD		10.000.000,00	98,41%	USD	94,74%	101.154,76	9.575.305,14	1,4%
HAITONG SECURITIES, FRN, 13/12/2023, CORP		2.200.000,00	100,14%	EUR	100,14%	1.421,20	2.204.479,20	0,3%
HCA, 5.625%, 01/09/2028, CORP, USD, CALL		3.100.000,00	98,44%	USD	94,77%	55.493,04	2.993.285,48	0,4%
HESS, 3.5%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL		2.000.000,00	98,42%	USD	94,75%	30.887,96	1.925.910,58	0,3%
INT CONSOLIDATED AIRLINE, 0.625%, 17/11/2022, CONV		17.600.000,00	98,77%	EUR	98,77%	13.152,18	17.395.792,18	2,6%
INTERNATIONAL GAME TECH, 3.5%, 15/06/2026, CORP, CALL		1.100.000,00	90,92%	EUR	90,92%	1.604,17	1.001.713,17	0,1%
INTL CONSOL AIRLINES, 0.5%, 04/07/2023, CORP, CALL		7.000.000,00	93,50%	EUR	93,50%	34.616,44	6.579.616,44	1,0%
INVIA, 5%, 15/10/2026, CORP, USD, CALL, 144A		3.000.000,00	95,36%	USD	91,81%	30.085,69	2.784.384,33	0,4%
LADBROKES GROUP, 5.125%, 16/09/2022, CORP, GBP		764.000,00	99,00%	GBP	115,36%	13.141,86	894.474,89	0,1%
LITHIA MOTORS, 4.625%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL 144A		2.000.000,00	92,20%	USD	88,76%	3.710,57	1.778.948,86	0,3%
MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL		3.000.000,00	97,76%	USD	94,11%	7.070,13	2.830.484,02	0,4%
MEITUAN, 2.125%, 28/10/2025, CORP, USD, CALL		200.000,00	90,14%	USD	86,79%	704,67	174.275,48	0,0%
MET LIFE, 0.375%, 09/04/2024, CORP		5.000.000,00	97,72%	EUR	97,72%	4.212,33	4.890.162,33	0,7%
MPT OPER, 3.325%, 24/03/2025, CORP, CALL		1.000.000,00	94,66%	EUR	94,66%	8.927,40	955.517,40	0,1%
NEXTRA ENERGY OP, 4.25%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL, 144A		3.000.000,00	95,77%	USD	92,20%	56.260,25	2.822.285,09	0,4%
NISSAN MOTOR, 2.652%, 17/03/2026, CORP, CALL		1.500.000,00	93,61%	EUR	93,61%	11.443,56	1.415.578,56	0,2%
PHILIP MORRIS, 0.625%, 08/11/2024, CORP, CALL		3.700.000,00	95,60%	EUR	95,60%	14.825,34	3.551.877,34	0,5%
SINOCHEM OFFSHORE, 1.625%, 29/10/2025, CORP, USD		1.000.000,00	92,09%	USD	88,66%	2.650,88	889.278,40	0,1%
TOWER BERSAMA, 2.75%, 20/01/2026, CORP, CALL, USD		1.800.000,00	89,06%	USD	85,74%	21.180,32	1.564.480,60	0,2%
TRITON CONTAINER, 2.05%, 15/04/2026, CORP, USD, CALL, 144A		2.000.000,00	88,46%	USD	85,16%	8.223,41	1.711.506,37	0,3%
UNITED RENTALS, 4.875%, 15/01/2028, CORP, USD, CALL		2.500.000,00	94,68%	USD	91,15%	53.778,17	2.332.636,35	0,3%
UTAH ACQUISITION SUB, 2.25%, 22/11/2024, CORP, CALL		1.000.000,00	97,24%	EUR	97,24%	13.561,64	985.961,64	0,1%
WEIBO, 1.25%, 15/11/2022, CORP, USD, CONV, 144A		6.700.000,00	98,45%	USD	94,78%	10.078,70	6.360.597,62	0,9%
ZHEJIANG SEAPORT, 1.98%, 17/03/2026, CORP, USD		2.000.000,00	92,97%	USD	89,51%	10.907,87	1.801.049,39	0,3%
ZHONGSHENG, 3%, 13/01/2026, CORP, USD, CALL		4.000.000,00	93,27%	USD	89,80%	53.592,61	3.645.467,07	0,5%
1.3.4. Acções						0,00	2.036.111,08	0,3%
CHONGQING RURAL COMMERCIAL, HK, HKD		5.884.000,00	2,82	HKD	0,35		2.036.111,08	0,3%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						0,00	62.932.588,28	9,4%
3.1. Fundos Harmonizados						0,00	62.932.588,28	9,4%
AXA WRLD EUR INF PLS-EURACC (FIM)		190.023,75	105,23	EUR	105,23		19.996.199,49	3,0%
ISHARES CORE EURO CORP BOND (FIM)		319.842,00	117,12	EUR	117,12		37.459.895,04	5,6%
ISHARES EUR CORP BBB-BB (FIM)		1.203.625,00	4,55	EUR	4,55		5.476.493,75	0,8%
5. Liquidez						0,00	2.478.430,60	0,4%
5.1. À Vista						0,00	2.478.430,60	0,4%
Depósitos à Ordem						0,00	2.478.430,60	0,4%
7. Operações Com Produtos Derivados						0,00	0,00	0,0%
7.1. Em Mercado Regulamentado						0,00	0,00	0,0%
7.1.1. Futuros						0,00	0,00	0,0%
EURGBP FX CURR FUT SET22		74,00	0,00	GBP	0,00		0,00	0,0%
EURUSD FX CURR FUT SET22		1.113,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9. Outros Activos						0,00	84.647,00	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores						0,00	84.647,00	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						0,00	0,19	0,0%
Impostos a Regularizar						0,00	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:

- 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.