

IB LEVE II

30 setembro 2023

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 setembro de 2023, 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					83.621,69	6.535.663,15	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					83.621,69	6.501.683,04	99,5%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					62.118,47	4.773.700,47	73,0%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					24.163,04	1.007.260,04	15,4%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	900.000,00	109,23%	EUR	109,23%	24.163,04	1.007.260,04	15,4%
1.2.3. Obrigações Diversas					37.955,43	3.766.440,43	57,6%
EDP, 2.375%, 27/11/2023, CORP, CALL	1.400.000,00	99,68%	EUR	99,68%	27.966,44	1.423.458,44	21,8%
EU, 0,8%, 04/07/2025, CORP	1.859.000,00	95,30%	EUR	95,30%	3.556,35	1.775.183,35	27,2%
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	300.000,00	87,67%	EUR	87,67%	2.078,13	265.079,13	4,1%
FRESENIUS SE & CO KGAA, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	300.000,00	99,46%	EUR	99,46%	4.354,51	302.719,51	4,6%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					21.503,22	1.727.982,57	26,4%
1.3.3. Obrigações Diversas					21.503,22	1.727.982,57	26,4%
ALIMENTATION COUCHE-TARD, 1.875%, 06/05/2026, CORP, CALL	150.000,00	94,07%	EUR	94,07%	1.129,61	142.234,61	2,2%
BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	500.000,00	98,92%	USD	93,37%	9.750,67	476.618,71	7,3%
BERRY GLOBAL, 1.5%, 15/01/2027, CORP, CALL	300.000,00	90,02%	EUR	90,02%	937,50	270.988,50	4,1%
CENTENE CORP, 4.25%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL	300.000,00	92,12%	USD	86,96%	3.510,24	264.380,55	4,0%
CRCC HEAN, 0.875%, 20/05/2026, 20/05/2026, CORP, CALL	300.000,00	90,72%	EUR	90,72%	953,89	273.125,89	4,2%
LLOYDS BANKING, 3.5%, 01/04/2026, CORP, CALL	300.000,00	98,47%	EUR	98,47%	5.221,31	300.634,31	4,6%
5. Liquidez					0,00	33.980,10	0,5%
5.1. À Vista						33.980,10	0,5%
Depósitos à Ordem						33.980,10	0,5%
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 DEZ23	6,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9. Outros Activos						0,01	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores						0,01	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						0,01	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.