

LEVE TRI

31 agosto 2022

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 31 agosto 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					1.612,23	4.427.959,13	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					1.612,23	4.427.959,13	100,0%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					0,00	0,00	0,0%
1.1.4. Acções						0,00	0,0%
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%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					1.612,23	4.427.959,13	100,0%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					1.612,23	1.080.310,11	24,4%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	35.000,00	101,30%	EUR	101,30%	230,14	35.684,44	0,8%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	20.000,00	63,08%	EUR	63,08%	169,08	12.784,48	0,3%
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	50.000,00	81,42%	EUR	81,42%	0,00	40.709,50	0,9%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	110.000,00	79,92%	EUR	79,92%	0,00	87.906,50	2,0%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	107.000,00	63,79%	EUR	63,79%	0,00	68.251,02	1,5%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	30.000,00	96,15%	EUR	96,15%	6,58	28.850,08	0,7%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	65.000,00	86,93%	EUR	86,93%	0,00	56.505,15	1,3%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	83,96%	EUR	83,96%	0,00	30.227,04	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	264.000,00	94,60%	EUR	94,60%	504,49	250.248,49	5,7%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	60.000,00	89,50%	EUR	89,50%	201,37	53.903,17	1,2%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	28.000,00	95,36%	EUR	95,36%	171,91	26.872,15	0,6%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	10.000,00	56,21%	EUR	56,21%	0,00	5.621,00	0,1%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	27.000,00	95,17%	EUR	95,17%	26,08	25.722,79	0,6%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	270.000,00	96,42%	EUR	96,42%	0,00	260.325,90	5,9%
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	20.000,00	74,79%	EUR	74,79%	46,85	15.005,25	0,3%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	7.000,00	81,52%	EUR	81,52%	2,36	5.709,04	0,1%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	46.000,00	83,31%	EUR	83,31%	191,56	38.512,78	0,9%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	12.000,00	69,50%	EUR	69,50%	10,52	8.350,64	0,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	30.000,00	96,90%	EUR	96,90%	51,29	29.120,69	0,7%
1.2.4. Acções						3.347.649,02	75,6%
ADIDAS, GY	98,00	148,42	EUR	148,42		14.545,16	0,3%
AHOLD DELHAIZE, NA	816,00	27,44	EUR	27,44		22.391,04	0,5%
AIR LIQUIDE, FP	362,00	125,58	EUR	125,58		45.459,96	1,0%
AIRBUS GROUP, FP	492,00	98,48	EUR	98,48		48.452,16	1,1%
AKZO NOBEL, NA	167,00	63,30	EUR	63,30		10.571,10	0,2%
ALLIANZ, GY	160,00	168,78	EUR	168,78		27.004,80	0,6%
AMADEUS, SA, SM	460,00	52,68	EUR	52,68		24.232,80	0,5%
ASML HOLDING, NA	284,00	486,35	EUR	486,35		138.123,40	3,1%
ASR NEDERLAND NV, NA	512,00	40,69	EUR	40,69		20.833,28	0,5%
AXA, FP	452,00	23,60	EUR	23,60		10.664,94	0,2%
BANCO SABADELL, SM	16.680,00	0,69	EUR	0,69		11.455,82	0,3%
BANCO SANTANDER, SM	8.585,00	2,43	EUR	2,43		20.822,92	0,5%
BASF, GY	379,00	42,13	EUR	42,13		15.967,27	0,4%
BAYER, GY	676,00	52,49	EUR	52,49		35.483,24	0,8%
BMW, GY	212,00	73,58	EUR	73,58		15.598,96	0,4%
BNP PARIBAS, FP	395,00	46,60	EUR	46,60		18.407,00	0,4%
CAIXABANK SA, SM	12.107,00	2,99	EUR	2,99		36.224,14	0,8%
CAP GEMINI, FP	208,00	174,05	EUR	174,05		36.202,40	0,8%
CARREFOUR, FP	792,00	16,61	EUR	16,61		13.155,12	0,3%
CELLNEX TELECOM, SM	417,00	38,87	EUR	38,87		16.208,79	0,4%
COMMERZBANK, GY	1.490,00	6,63	EUR	6,63		9.881,68	0,2%
CRH, ID	709,00	36,65	EUR	36,65		25.981,31	0,6%
DANONE, FP	269,00	52,35	EUR	52,35		14.082,15	0,3%
DEUTSCHE BOERSE, GY	97,00	168,10	EUR	168,10		16.305,70	0,4%
DEUTSCHE POST, GY	850,00	36,60	EUR	36,60		31.110,00	0,7%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	2.770,00	18,79	EUR	18,79		52.053,84	1,2%
DSM, NA	175,00	128,20	EUR	128,20		22.435,00	0,5%
E.ON, GY	1.487,00	8,53	EUR	8,53		12.687,08	0,3%
ENEL, IM	4.587,00	4,71	EUR	4,71		21.591,01	0,5%
ENI SPA, IM	1.984,00	11,78	EUR	11,78		23.363,58	0,5%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	1.035,00	22,62	EUR	22,62		23.411,70	0,5%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	163,00	149,25	EUR	149,25		24.327,75	0,5%
ESSITY AB, SS, SEK	427,00	237,00	SEK	22,19		9.476,63	0,2%
FERROVIAL, SM	438,00	24,97	EUR	24,97		10.936,86	0,2%
HERMES, FP	27,00	1.280,50	EUR	1.280,50		34.573,50	0,8%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	995,00	21,60	EUR	21,60		21.492,00	0,5%
INFINEON, GY	375,00	24,36	EUR	24,36		9.133,13	0,2%
ING Groep, NA	5.222,00	8,78	EUR	8,78		45.864,83	1,0%
KERING, FP	45,00	504,40	EUR	504,40		22.698,00	0,5%
KONINKLIJKE PHILIPS NV, NA	769,00	16,67	EUR	16,67		12.817,69	0,3%
L' OREAL, FP	156,00	343,80	EUR	343,80		53.632,80	1,2%
LVMH, FP	181,00	649,20	EUR	649,20		117.505,20	2,7%
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	569,00	56,46	EUR	56,46		32.125,74	0,7%
MERCK KGAA, GY	89,00	171,90	EUR	171,90		15.299,10	0,3%
MICHELIN, FP	724,00	24,39	EUR	24,39		17.658,36	0,4%
NOKIA, FH	6.952,00	5,02	EUR	5,02		34.892,09	0,8%
PERNOD-RICARD, FP	177,00	183,85	EUR	183,85		32.541,45	0,7%
RWE, GY	414,00	38,11	EUR	38,11		15.777,54	0,4%
SAFRAN, FP	104,00	102,14	EUR	102,14		10.622,56	0,2%
SAMPO OYJ, FH	522,00	45,07	EUR	45,07		23.526,54	0,5%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	624,00	82,70	EUR	82,70		51.604,80	1,2%
SAP, GY	487,00	85,12	EUR	85,12		41.453,44	0,9%
SCHNEIDER, FP	257,00	118,70	EUR	118,70		30.505,90	0,7%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
SHELL PLC, NA	394,00	26,30	EUR	26,30		10.362,20	0,2%
SIEMENS, GY	586,00	101,66	EUR	101,66		59.572,76	1,3%
SOCIETE GENERALE, FP	1.582,00	22,13	EUR	22,13		35.009,66	0,8%
ST.GOBAIN, FP	617,00	40,48	EUR	40,48		24.973,08	0,6%
TELE2 AB-B SHS, SS, SEK	866,00	113,55	SEK	10,63		9.208,37	0,2%
TELEFONICA, SM	4.932,00	4,12	EUR	4,12		20.300,11	0,5%
TELEPERFORMANCE, FP	32,00	285,10	EUR	285,10		9.123,20	0,2%
THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	160,00	120,35	EUR	120,35		19.256,00	0,4%
TOTALENERGIES SE, FP	1.398,00	50,68	EUR	50,68		70.850,65	1,6%
UNICREDIT, IM	4.058,00	9,73	EUR	9,73		39.464,05	0,9%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	549,00	22,44	EUR	22,44		12.319,56	0,3%
VINCI, FP	356,00	92,15	EUR	92,15		32.805,40	0,7%
VOLKSWAGEN PFD, GY	138,00	143,00	EUR	143,00		19.734,00	0,4%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	110.129,02	2,5%
1.3.4. Acções					0,00	110.129,02	2,5%
ASSTEAD GROUP, LN, GBP	194,00	42,43	GBP	49,32		9.567,52	0,2%
BP AMOCO PLC, LN, GBP	2.139,00	4,40	GBP	5,12		10.950,46	0,2%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	101,00	110,01	CHF	112,30		11.341,98	0,3%
GLENCORE XSTRATA, LN, GBP	2.026,00	4,74	GBP	5,51		11.162,02	0,3%
NATWEST GROUP, LN, GBP	3.308,00	2,45	GBP	2,85		9.425,89	0,2%
OCADO, LN, GBP	963,00	7,24	GBP	8,42		8.106,07	0,2%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	212,00	66,58	GBP	77,39		16.406,07	0,4%
STELLANTIS NV, IM	2.479,00	13,38	EUR	13,38		33.169,02	0,7%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	886.789,69	20,0%
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	886.789,69	20,0%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	1.273,30	196,14	EUR	196,14		249.745,45	5,6%
CAIXA DISPONIVEL, FIM	20.043,33	5,18	EUR	5,18		103.830,47	2,3%
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM)	2.258,00	39,68	EUR	39,68		89.586,15	2,0%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM)	1.048,00	85,95	EUR	85,95		90.075,60	2,0%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	1.594,08	155,59	EUR	155,59		248.022,75	5,6%
X MSCI JAPAN EUR, FIM	4.199,00	25,13	EUR	25,13		105.529,27	2,4%
4. Imobiliário					0,00	270.173,23	6,1%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário					0,00	270.173,23	6,1%
FUNDIMO (FII)	33.016,00	8,18	EUR	8,18		270.173,23	6,1%
5. Líquidez					0,00	205.570,60	4,6%
5.1. À Vista					0,00	205.570,60	4,6%
Depósitos à Ordem					0,00	205.570,60	4,6%
9. Outros Activos					0,00	8.834,19	0,2%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	8.834,19	0,2%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	0,11	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	925,44	0,0%
Impostos a Regularizar					0,00	14.769,19	0,3%
Comissões					0,00	-6.860,55	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

4.427.959,13

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

853.481,30

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

5,18812

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.

Ano	Rendibilidade	Volatilidade	Rend. Anualizada	
2008	-21,35%	14,29%	1 Ano	9,98%
2009	12,13%	10,39%	3 Anos	7,25%
2010	-1,04%	11,06%	5 Anos	2,61%
2011	-7,30%	13,27%	Desde o Início	1,24%
2012	11,06%	7,83%		
2013	10,76%	7,91%		
2014	1,18%	9,63%		
2015	6,19%	11,04%		
2016	-1,84%	10,08%		
2017	1,51%	5,45%		
2018	-9,19%	8,20%		
2019	10,48%	5,98%		
2020	1,55%	16,87%		
2021	9,98%	6,33%		

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