

LEVE DUO

31 dezembro 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)
Parte I - Valores Patrimoniais					8.817.803,72	591.712.751,74
1. Valores Mobiliários Cotados					8.817.803,72	553.489.072,84
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					1.653.637,87	64.622.258,40
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					1.206.858,19	54.183.519,57
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	93,07%	EUR	93,07%	31.894,55	2.823.994,55
PGB, 2.875%, 15/10/2025, GOVT	7.382,78	99,98%	EUR	99,98%	44,78	7.426,16
PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT	5.000.000,00	103,97%	EUR	103,97%	169.332,22	5.367.982,22
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	31.000.000,00	104,63%	EUR	104,63%	914.393,85	33.349.383,85
PGB, 4.95%, 25/10/2023, GOVT	4.000.000,00	101,81%	EUR	101,81%	36.345,21	4.108.585,21
REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	84,71%	EUR	84,71%	54.847,58	8.526.147,58
1.1.3. Obrigações Diversas					446.779,68	10.393.399,68
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP	9.000.000,00	110,52%	EUR	110,52%	446.779,68	10.393.399,68
1.1.4. Acções					0,00	45.339,15
BES, PL (EM LIQUIDACAO)	99.815,00	0,00	EUR	0,00		0,00
CTT, PL	2.714,00	3,08	EUR	3,08		8.345,55
REN, PL	14.680,00	2,52	EUR	2,52		36.993,60
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					5.911.795,96	327.248.809,57
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					5.615.372,19	5.865.190,11
BTPS, 0.35%, 17/11/2028, GOVT	2.000.000,00	82,20%	EUR	82,20%	850,83	1.644.890,83
BTPS, 2.45%, 01/10/2023, GOVT	9.000.000,00	99,75%	EUR	99,75%	55.125,01	9.032.265,01
BTPS, 2.5%, 01/12/2024, GOVT	5.000.000,00	98,70%	EUR	98,70%	10.302,20	4.945.452,20
BTPS, 3.75%, 01/09/2024, GOVT	1.500.000,00	100,84%	EUR	100,84%	18.801,80	1.531.431,80
BTPS, 4.5%, 01/05/2023, GOVT	8.200.000,00	100,67%	EUR	100,67%	61.160,22	8.315.772,22
BTPS, 4.75%, 01/08/2023, GOVT	32.300.000,00	101,17%	EUR	101,17%	633.712,02	33.310.653,02
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	14.000.000,00	103,65%	EUR	103,65%	222.279,06	14.732.579,06
BTPS, 5.25%, 01/11/29, GOVT	4.000.000,00	106,67%	EUR	106,67%	35.386,73	4.301.986,73
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	14.000.000,00	111,90%	EUR	111,90%	150.828,72	15.816.828,72
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	92,13%	EUR	92,13%	51.945,21	18.477.345,21
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	900.000,00	89,18%	EUR	89,18%	9.490,56	812.146,56
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	3.000.000,00	76,16%	EUR	76,16%	2.013,70	2.286.723,70
SPGB, 0.6%, 31/10/2029, GOVT	5.000.000,00	83,84%	EUR	83,84%	5.013,70	4.197.163,70
SPGB, 2.75%, 31/10/2024, GOVT	28.900.000,00	99,67%	EUR	99,67%	132.821,23	28.936.295,23
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	23.000.000,00	109,98%	EUR	109,98%	197.957,53	25.494.277,53
SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT	15.140.000,00	100,30%	EUR	100,30%	748.123,40	15.933.240,60
SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT	24.500.000,00	118,37%	EUR	118,37%	594.376,71	29.594.536,71
SPGB, 5.9%, 30/07/2026, GOVT	2.000.000,00	109,72%	EUR	109,72%	49.786,30	2.244.226,30
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	48.000.000,00	115,21%	EUR	115,21%	2.635.397,26	57.936.677,26
1.2.3. Obrigações Diversas					296.423,77	41.839.127,07
ACCOR, 2.375%, 29/11/2028, CORP, CALL	3.500.000,00	85,77%	EUR	85,77%	7.287,67	3.009.202,67
AKER BP ASA, 2.875%, 15/01/2026, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	92,43%	USD	86,66%	18.643,74	1.318.479,67
BANCO SANTANDER, 1.125%, 23/06/2027, CORP	2.500.000,00	88,80%	EUR	88,80%	14.717,47	2.234.667,47

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)
BANCO SANTANDER, 3.25%, 04/04/2026, CORP	4.100.000,00	96,92%	EUR	96,92%	98.933,56	4.072.612,56
BBVA, 0.375%, 02/10/2024, CORP	400.000,00	94,90%	EUR	94,90%	369,86	379.949,86
BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP	2.600.000,00	87,20%	EUR	87,20%	12.501,37	2.279.805,37
BNP PARIBAS, 2.875%, 01/10/2026, CORP	2.000.000,00	96,22%	EUR	96,22%	14.335,62	1.938.795,62
CAIXABANK, 0.625%, 01/10/2024, CORP	5.000.000,00	94,78%	EUR	94,78%	7.791,10	4.746.991,10
CAIXABANK, 1.75%, 24/10/2023, CORP	3.000.000,00	98,89%	EUR	98,89%	9.780,82	2.976.480,82
CAIXABANK, 2.375%, 01/02/2024, CORP	600.000,00	99,10%	EUR	99,10%	13.000,68	607.570,68
CARREFOUR SA, CZ, 14/06/2023, CORP, USD, CONV	8.400.000,00	97,52%	USD	91,43%	0,00	7.679.943,75
CREDIT AGRICOLE, 2.7%, 15/07/2025, CORP	300.000,00	96,30%	EUR	96,30%	1.694,84	290.579,84
CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP	175.000,00	95,42%	EUR	95,42%	880,94	167.860,69
CRITERIA CAIXA, 1.375%, 10/04/2024, CORP	2.000.000,00	97,26%	EUR	97,26%	19.965,75	1.965.205,75
DELL BANK, 1.625%, 24/06/2024, CORP, CALL	1.000.000,00	96,41%	EUR	96,41%	8.458,90	972.548,90
EP INFRASTRUCTURE, 1.659%, 26/04/2024, CORP, CALL	4.000.000,00	88,11%	EUR	88,11%	45.270,25	3.569.630,25
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	1.050.000,00	83,55%	EUR	83,55%	1.039,06	878.293,06
FRESENIUS SE & CO KGAA, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	500.000,00	98,37%	EUR	98,37%	1.921,23	493.766,23
JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, GOVT	1.590.000,00	87,88%	EUR	87,88%	14.878,65	1.412.202,45
RYANAIR DAC, 0.875%, 25/05/2026, CORP	939.000,00	89,41%	EUR	89,41%	4.952,26	844.540,33
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	1.889.094,91
1.3.3. Obrigações Diversas					1.252.369,89	159.728.909,96
ALEXANDER FUND, 1.841%, 15/11/2023, CORP, USD, CALL, 144A	5.000.000,00	94,52%	USD	88,61%	11.027,51	4.441.741,94
AMC NETWORKS, 5%, 01/04/2024, CORP, USD, CALL	513.261,00	93,76%	USD	87,91%	5.948,32	457.152,18
AMERICAN AIRLINES, 4.4%, 22/09/2023 (EXT DT 2025) CORP, SMI	3.126.049,61	96,54%	USD	90,51%	35.463,34	2.864.851,83
ASHTREAD, 4%, 01/05/2028, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	91,24%	USD	85,54%	12.500,78	1.723.263,96
BAIDU INC, 3.875%, 29/09/2023, CORP, USD, CALL	1.500.000,00	98,62%	USD	92,47%	13.926,65	1.400.927,40
BARCLAYS, 3%, 08/05/2026, CORP, GBP	2.000.000,00	90,75%	GBP	102,32%	43.925,58	2.090.377,95
BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	11.500.000,00	98,60%	USD	92,45%	106.134,56	10.737.327,13
BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL	400.000,00	92,16%	EUR	92,16%	6.856,44	375.512,44
BOEING CO, 4.875%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	99,19%	USD	93,00%	15.235,33	1.875.220,33
CANARY WHARF, 2.625%, 23/04/2025, CORP, GBP, CALL	4.300.000,00	85,10%	GBP	95,95%	24.124,38	4.150.026,09
CGNPC INTERN, 3.75%, 11/12/2027, CORP, USD	4.464.000,00	94,83%	USD	88,90%	8.719,30	3.977.435,44
CGNPC INTERNATIONAL LTD, 2%, 11/09/2025, CORP	2.000.000,00	94,00%	EUR	94,00%	12.164,38	1.892.084,38
CHINA CINDA FINANCE 2017, 4.1%, 09/03/2024, CORP, USD	10.000.000,00	97,71%	USD	91,61%	119.590,81	9.280.757,13
CHN CLEAN ENERGY DEVELOP, 4%, 05/11/2025, CORP, USD	1.450.000,00	96,30%	USD	90,28%	8.458,86	1.317.578,03
CNOOC CURTIS FUND, 4.5%, 03/10/2023, CORP, USD	4.000.000,00	99,48%	USD	93,27%	41.252,58	3.771.910,75
COLONY NORTHSTAR, 5%, 15/04/2023, CORP, USD, CONV	8.000.000,00	98,85%	USD	92,67%	79.171,61	7.493.159,98
CORNWALL JERSEY, 0.75%, 16/04/2026, CORP, GBP, CALL, CO	1.500.000,00	58,44%	GBP	65,89%	2.648,35	991.052,17
CSSC CAPITAL, 1.75%, 27/09/2023, CORP	9.900.000,00	97,73%	EUR	97,73%	45.092,47	9.719.867,47
DELTA AIR LINES, 4.5%, 20/10/2025, CORP, USD, SINK, 144A	2.000.000,00	97,47%	USD	91,39%	16.641,67	1.844.355,90
DRAX, 6.625%, 01/11/2025, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	96,15%	USD	90,15%	15.528,31	1.367.708,13
EBAY, 3.45%, 01/08/2024, CORP, USD, CALL	5.000.000,00	97,37%	USD	91,29%	67.387,02	4.631.703,54
ENERGY TRANSFER OPER, 5.5%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL	1.800.000,00	99,39%	USD	93,18%	7.734,86	1.685.012,19
ENERGY TRANSFER, 4.2%, 15/04/2027, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	94,38%	USD	88,49%	16.626,04	1.786.399,15
EXPEDIA GROUP, 6.25%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	100,72%	USD	94,43%	14.649,35	1.431.141,00
FREEPORT-MCMORAN INC, 4.125%, 01/03/2028, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	92,84%	USD	87,04%	12.891,43	883.311,46
FRESNILLO, 5.5%, 13/11/2023, CORP, USD	333.000,00	99,86%	USD	93,63%	2.289,52	314.062,56
FUQING INV, 3.25%, 23/06/2025, CORP, USD	30.000.000,00	66,99%	USD	62,80%	20.313,77	18.861.022,57
HAITONG INTL SECURITIES, 2.125%, 02/07/2023, CORP, USD	9.000.000,00	98,13%	USD	92,00%	89.155,96	8.369.476,60
HAITONG SECURITIES, FRN, 13/12/2023, CORP	2.200.000,00	100,61%	EUR	100,61%	4.020,50	2.217.418,50
HESS, 3.5%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	97,06%	USD	91,00%	30.262,30	1.850.288,55
INTERNATIONAL GAME TECH, 3.5%, 15/06/2026, CORP, CALL	1.100.000,00	95,13%	EUR	95,13%	1.711,11	1.048.086,11
INTL CONSOL AIRLINES, 0.5%, 04/07/2023, CORP, CALL	7.000.000,00	97,40%	EUR	97,40%	17.260,27	6.835.260,27
IQVIA, 5%, 15/10/2026, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	95,85%	USD	89,86%	29.689,36	2.725.526,61
LITHIA MOTORS, 4.625%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	91,09%	USD	85,40%	8.854,41	1.711.842,41
MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL	3.000.000,00	98,09%	USD	91,97%	7.344,21	2.766.297,89
MEITUAN, 2.125%, 28/10/2025, CORP, USD, CALL	200.000,00	88,84%	USD	83,29%	697,31	167.278,97
MET LIFE, 0.375%, 09/04/2024, CORP	5.000.000,00	96,20%	EUR	96,20%	13.664,38	4.823.414,38
MPT OPER, 3.325%, 24/03/2025, CORP, CALL	1.000.000,00	90,57%	EUR	90,57%	25.689,04	931.419,04
NEXTERA ENERGY CAPITAL, FRN, 03/11/2023, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	99,60%	USD	93,38%	4.389,31	1.872.024,79
NEXTERA ENERGY OP, 4.25%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	97,18%	USD	91,11%	55.120,65	2.788.563,37
NISSAN MOTOR, 2.652%, 17/03/2026, CORP, CALL	1.500.000,00	92,64%	EUR	92,64%	31.497,04	1.421.037,04
PHILIP MORRIS, 0.625%, 08/11/2024, CORP, CALL	3.700.000,00	94,27%	EUR	94,27%	3.357,88	3.491.384,88
QORVO, 1.75%, 15/12/2024, CORP, CALL, USD, 144A	1.250.000,00	92,26%	USD	86,50%	911,52	1.082.197,86
SINOCEM OFFSHORE, 1.625%, 29/10/2025, CORP, USD	1.000.000,00	89,46%	USD	83,88%	2.581,54	841.340,21
T-MOBILE USA, 2.25%, 15/02/2026, CORP, USD, CALL	1.500.000,00	91,07%	USD	85,39%	12.129,66	1.292.909,70
TOWER BERSAMA, 2.75%, 20/01/2026, CORP, CALL, USD	1.800.000,00	90,29%	USD	84,65%	20.755,21	1.544.527,95
TRITON CONTAINER, 2.05%, 15/04/2026, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	87,10%	USD	81,66%	8.115,08	1.641.285,90
UNITED AIRLINES, 4.15%, 11/04/2024 (EX DT 2025), CORP, USD,	640.503,88	96,42%	USD	90,40%	5.538,04	584.567,72
UNITED RENTALS, 4.875%, 15/01/2028, CORP, USD, CALL	2.500.000,00	94,75%	USD	88,83%	52.688,85	2.273.554,22
UTAH ACQUISITION SUB, 2.25%, 22/11/2024, CORP, CALL	1.000.000,00	96,50%	EUR	96,50%	2.404,11	967.424,11
ZHEJIANG SEAPORT, 1.98%, 17/03/2026, CORP, USD	2.000.000,00	90,78%	USD	85,11%	10.725,67	1.712.994,56
ZHONGSHENG, 3%, 13/01/2026, CORP, USD, CALL	4.000.000,00	89,36%	USD	83,78%	52.503,26	3.403.825,22
1.3.4. Acções					0,00	1.889.094,91
CHONGQING RURAL COMMERCIAL, HK, HKD	5.884.000,00	2,67	HKD	0,32		1.889.094,91
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	20.207.125,86
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	20.207.125,86
AXA WRLD EUR INF PLS-HEURACC (FIM)	190.023,75	106,34	EUR	106,34		20.207.125,86
5. Liquidez					0,00	17.931.906,05
5.1. À Vista					0,00	17.931.906,05
Depósitos à Ordem					0,00	17.931.906,05
7. Operações Com Produtos Derivados					0,00	0,00
7.1. Em Mercado Regulamentado					0,00	0,00
7.1.1. Futuros					0,00	0,00
EURGBP FX CURR FUT MAR23	60,00	0,00	GBP	0,00		0,00
EURUSD FX CURR FUT JUN23	69,00	0,00	USD	0,00		0,00
EURUSD FX CURR FUT MAR23	1.001,00	0,00	USD	0,00		0,00
9. Outros Activos					0,00	84.646,99
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	84.646,99
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	0,18
Impostos a Regularizar					0,00	84.646,81

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.