

LEVE TRI

31 dezembro 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 na data de referência, 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					4.336,97	4.298.693,52
1. Valores Mobiliários Cotados					4.336,97	4.298.693,52
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					0,00	0,00
1.1.4. Acções						0,00
BANIF, PL	247.226,00	0,00	EUR	0,00		0,00
BES, PL (EM LIQUIDACAO)	22.523,00	0,00	EUR	0,00		0,00
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					4.336,97	3.132.467,84
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					4.053,41	1.217.100,40
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	35.000,00	93,28%	EUR	93,28%	510,90	33.160,30
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	20.000,00	55,57%	EUR	55,57%	113,65	11.226,65
DBR, 0%, 15/05/2035, GOVT	50.000,00	72,87%	EUR	72,87%	0,00	36.433,00
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	110.000,00	70,97%	EUR	70,97%	0,00	78.069,20
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	107.000,00	52,18%	EUR	52,18%	0,00	55.830,46
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	30.000,00	91,50%	EUR	91,50%	56,71	27.505,51
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	65.000,00	79,94%	EUR	79,94%	0,00	51.962,30
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	79,29%	EUR	79,29%	0,00	28.545,84
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	264.000,00	90,82%	EUR	90,82%	65,10	239.816,70
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	90.000,00	81,74%	EUR	81,74%	678,08	74.246,78
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	28.000,00	89,03%	EUR	89,03%	298,26	25.225,54
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	10.000,00	48,46%	EUR	48,46%	0,00	4.846,00
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	33.000,00	113,48%	EUR	113,48%	1.186,64	38.635,70
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	127.000,00	90,28%	EUR	90,28%	441,02	115.092,81
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	270.000,00	93,36%	EUR	93,36%	0,00	252.082,80
RAGB, 0%, 15/07/2023, GOVT	20.000,00	98,81%	EUR	98,81%	0,00	19.762,40
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	20.000,00	68,28%	EUR	68,28%	9,86	13.664,86
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	60.000,00	57,57%	EUR	57,57%	352,60	34.892,20
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	7.000,00	76,46%	EUR	76,46%	4,70	5.357,04
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	46.000,00	77,81%	EUR	77,81%	38,44	35.830,58
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	12.000,00	61,11%	EUR	61,11%	50,63	7.384,31
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	30.000,00	90,94%	EUR	90,94%	246,82	27.529,42
1.2.3. Obrigações Diversas					283,56	43.000,71
IRISH, 1% 15/05/2026, GOVT	45.000,00	94,93%	EUR	94,93%	283,56	43.000,71
1.2.4. Acções						3.038.592,41
ADIDAS, GY	163,00	127,44	EUR	127,44		20.772,72
AHOLD DELHAIZE, NA	518,00	26,89	EUR	26,89		13.929,02
AIR LIQUIDE, FP	339,00	133,26	EUR	133,26		45.175,14
AIRBUS GROUP, FP	460,00	111,64	EUR	111,64		51.354,40
ALLIANZ, GY	150,00	201,10	EUR	201,10		30.165,00
AMADEUS, SA, SM	431,00	48,60	EUR	48,60		20.946,60
ASML HOLDING, NA	266,00	507,00	EUR	507,00		134.862,00
ASR NEDERLAND NV, NA	480,00	44,44	EUR	44,44		21.331,20
AXA, FP	423,00	26,16	EUR	26,16		11.065,68
BANCO SABADELL, SM	15.621,00	0,88	EUR	0,88		13.768,35
BANCO SANTANDER, SM	8.043,00	2,80	EUR	2,80		22.548,55
BASF, GY	692,00	46,50	EUR	46,50		32.178,00
BAYER, GY	630,00	48,53	EUR	48,53		30.573,90
BMW, GY	199,00	83,32	EUR	83,32		16.580,68
BNP PARIBAS, FP	370,00	53,48	EUR	53,48		19.787,60
CAIXABANK SA, SM	11.343,00	3,67	EUR	3,67		41.628,81
CAP GEMINI, FP	195,00	156,95	EUR	156,95		30.605,25
CARREFOUR, FP	743,00	15,62	EUR	15,62		11.605,66
CELLNEX TELECOM, SM	390,00	31,01	EUR	31,01		12.093,90
COMMERZBANK, GY	1.396,00	8,81	EUR	8,81		12.301,55
CRH, ID	664,00	37,01	EUR	37,01		24.574,64
DANONE, FP	252,00	49,41	EUR	49,41		12.450,06
DEUTSCHE BOERSE, GY	91,00	161,35	EUR	161,35		14.682,85
DEUTSCHE POST, GY	693,00	35,27	EUR	35,27		24.442,11
DEUTSCHE TELEKOM, GY	2.595,00	18,68	EUR	18,68		48.484,98
DSM, NA	117,00	114,95	EUR	114,95		13.449,15
ENEL, IM	6.840,00	5,05	EUR	5,05		34.562,52
ENI SPA, IM	1.859,00	13,37	EUR	13,37		24.862,27
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	698,00	29,95	EUR	29,95		20.905,10
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00
ESSILOR, FP	153,00	169,85	EUR	169,85		25.987,05
ESSITY AB, SS, SEK	400,00	273,70	SEK	24,61		9.843,73
FERROVIAL, SM	411,00	24,60	EUR	24,60		10.110,60
HERMES, FP	26,00	1.454,00	EUR	1.454,00		37.804,00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	869,00	24,90	EUR	24,90		21.638,10
INFINEON, GY	351,00	28,49	EUR	28,49		9.998,24
ING Groep, NA	4.880,00	11,44	EUR	11,44		55.817,44
KERING, FP	42,00	479,05	EUR	479,05		20.120,10

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)
KONINKLUKE PHILIPS NV, NA	720,00	14,04	EUR	14,04		10.108,80
L' OREAL, FP	146,00	334,65	EUR	334,65		48.858,90
LVMH, FP	170,00	683,20	EUR	683,20		116.144,00
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	533,00	61,40	EUR	61,40		32.726,20
MERCK KGAA, GY	83,00	181,55	EUR	181,55		15.068,65
MICHELIN, FP	678,00	26,11	EUR	26,11		17.702,58
NESTE OYJ, FH	332,00	43,26	EUR	43,26		14.362,32
NOKIA, FH	6.514,00	4,35	EUR	4,35		28.309,84
PERNOD-RICARD, FP	166,00	184,80	EUR	184,80		30.676,80
RWE, GY	388,00	41,64	EUR	41,64		16.156,32
SAFRAN, FP	98,00	117,12	EUR	117,12		11.477,76
SAMPO OYJ, FH	489,00	48,95	EUR	48,95		23.936,55
SANOFI-SYNTHELABO, FP	584,00	90,15	EUR	90,15		52.647,60
SAP, GY	457,00	96,33	EUR	96,33		44.022,81
SCHNEIDER, FP	241,00	131,40	EUR	131,40		31.667,40
SHELL PLC, NA	369,00	26,57	EUR	26,57		9.804,33
SIEMENS, GY	549,00	129,36	EUR	129,36		71.018,64
SOCIETE GENERALE, FP	1.319,00	23,54	EUR	23,54		31.042,67
ST.GOBAIN, FP	578,00	45,75	EUR	45,75		26.440,61
TELE2 AB-B SHS, SS, SEK	812,00	85,48	SEK	7,69		6.240,87
TELEFONICA, SM	4.621,00	3,39	EUR	3,39		15.646,71
TELEPERFORMANCE, FP	60,00	224,10	EUR	224,10		13.446,00
THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	122,00	119,15	EUR	119,15		14.536,30
TOTALENERGIES SE, FP	1.230,00	58,99	EUR	58,99		72.557,71
UNICREDIT, IM	3.127,00	13,27	EUR	13,27		41.489,04
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	514,00	24,13	EUR	24,13		12.402,82
VINCI, FP	334,00	93,64	EUR	93,64		31.275,76
VONOVIA SE, GY	855,00	21,96	EUR	21,96		18.775,80
ZALANDO SA, GY	325,00	33,28	EUR	33,28		10.816,00
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	98.428,09
1.3.4. Acções					0,00	98.428,09
ASHTEAD GROUP, LN, GBP	180,00	47,20	GBP	53,22		9.579,11
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	95,00	121,12	CHF	123,00		11.685,47
GLENCORE XSTRATA, LN, GBP	1.899,00	5,52	GBP	6,23		11.827,40
NATWEST GROUP, LN, GBP	3.100,00	2,65	GBP	2,99		9.269,28
OCADO, LN, GBP	1.747,00	6,17	GBP	6,95		12.149,22
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	199,00	57,54	GBP	64,88		12.910,22
STELLANTIS NV, IM	2.323,00	13,35	EUR	13,35		31.007,40
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	734.629,51
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	734.629,51
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	112,40	191,26	EUR	191,26		21.497,43
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	1.994,00	106,99	EUR	106,99		213.338,06
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	2.258,00	41,40	EUR	41,40		93.481,20
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM), ETF	1.048,00	81,94	EUR	81,94		85.873,12
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	143,15	151,48	EUR	151,48		21.684,36
X MSCI JAPAN EUR, FIM, ETF	3.472,00	24,60	EUR	24,60		85.393,84
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	2.211,00	96,50	EUR	96,50		213.361,50
4. Imobiliário					0,00	272.253,24
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário					0,00	272.253,24
FUNDIMO (FI)	33.016,00	8,25	EUR	8,25		272.253,24
5. Liquidez					0,00	52.609,74
5.1. À Vista					0,00	52.609,74
Depósitos à Ordem					0,00	52.609,74
9. Outros Activos					0,00	8.305,10
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	8.305,10
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	0,11
Transacções a Liquidar					0,00	0,00
Impostos a Regularizar					0,00	14.876,29
Comissões					0,00	-6.571,30

VALOR TOTAL DA CARTEIRA
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

4.298.693,52
825.253,65
5,20894

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	-13,17%
2009	12,13%	10,39%	3 Anos	-1,02%
2010	-1,04%	11,06%	5 Anos	-0,55%
2011	-7,30%	13,27%	Desde o Inicio	0,26%
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%		
2022	-13,17%	11,31%		

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