IB LEVE II

31 dezembro 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 31 dezembro 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					**43.153,74**	**5.532.698,44**	**100,0%**
1. Valores Mobiliários Cotados					**43.153,74**	**5.172.377,24**	**93,5%**
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					**24.813,27**	**3.437.673,64**	**62,1%**
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					**9.642,86**	**1.028.280,86**	**18,6%**
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	900.000,00	113,18%	EUR	113,18%	9.642,86	1.028.280,86	18,6%
1.2.3. Obrigações Diversas					**15.170,41**	**2.409.392,78**	**43,5%**
EU, 0,8%, 04/07/2025, CORP	1.859.000,00	97,04%	EUR	97,04%	7.314,10	1.811.343,47	32,7%
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	300.000,00	94,50%	EUR	94,50%	296,88	283.796,88	5,1%
FRESENIUS SE & CO KGAA, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	300.000,00	102,23%	EUR	102,23%	7.559,43	314.252,43	5,7%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					**18.340,47**	**1.734.703,60**	**31,4%**
1.3.3. Obrigações Diversas					**18.340,47**	**1.734.703,60**	**31,4%**
ALIMENTATION COUCHE-TARD, 1.875%, 06/05/2026, CORP, CALL	150.000,00	96,52%	EUR	96,52%	1.836,58	146.618,08	2,7%
BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	500.000,00	99,50%	USD	90,04%	4.454,19	454.671,39	8,2%
BERRY GLOBAL, 1.5%, 15/01/2027, CORP, CALL	300.000,00	93,60%	EUR	93,60%	2.062,50	282.856,50	5,1%
CENTENE CORP, 4.25%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL	300.000,00	96,59%	USD	87,41%	512,82	262.737,25	4,7%
CRCC HEAN, 0.875%, 20/05/2026, 20/05/2026, CORP, CALL	300.000,00	93,07%	EUR	93,07%	1.613,73	280.811,73	5,1%
LLOYDS BANKING, 3.5%, 01/04/2026, CORP, CALL	300.000,00	99,72%	EUR	99,72%	7.860,65	307.008,65	5,5%
5. Liquidez					**0,00**	**360.321,19**	**6,5%**
5.1. À Vista						**360.321,19**	**6,5%**
Depósitos à Ordem						360.321,19	6,5%
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 MAR24	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:

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.