

IB LEVE II

30 setembro 2021

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 2021, 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					147.573,01	8.108.793,28	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					147.573,01	7.895.513,41	97,4%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					77.165,52	3.635.710,89	44,8%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					68.818,99	2.759.505,86	34,0%
PGB, 2.875%, 15/10/2025, GOVT	1.859.000,00	113,79%	EUR	113,79%	51.249,81	2.166.661,68	26,7%
PGB, 5.65%, 15/02/2024, GOVT	500.000,00	115,06%	EUR	115,06%	17.569,18	592.844,18	7,3%
1.1.3. Obrigações Diversas					8.346,53	876.205,03	10,8%
SAUDACOR, FRN, 20/06/2022, CORP	850.000,00	102,10%	EUR	102,10%	8.346,53	876.205,03	10,8%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					53.027,89	3.029.792,21	37,4%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					48.255,92	2.404.413,24	29,7%
BTPS, 0.95%, 01/03/2023, GOVT	400.000,00	101,96%	EUR	101,96%	304,42	408.124,42	5,0%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	900.000,00	137,08%	EUR	137,08%	24.361,64	1.258.108,64	15,5%
NETHERLANDS, 3.75%, 15/01/2023, GOVT	12.000,00	105,79%	EUR	105,79%	318,08	13.012,40	0,2%
SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT	650.000,00	107,98%	EUR	107,98%	23.271,78	725.167,78	8,9%
1.2.3. Obrigações Diversas					4.771,97	625.378,97	7,7%
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	300.000,00	100,52%	EUR	100,52%	2.078,13	303.635,13	3,7%
NOKIA, 2.375%, 15/05/2025, CORP, CALL	300.000,00	106,35%	EUR	106,35%	2.693,84	321.743,84	4,0%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					17.379,60	1.230.010,31	15,2%
1.3.3. Obrigações Diversas					17.379,60	1.230.010,31	15,2%
AMERICAN AIRLINES, 3.7%, 01/05/2023 (EXT DT 2024) CORP, SINK, USD	151.498,68	98,16%	USD	84,77%	2.003,65	130.435,38	1,6%
AMG CAPITAL TRUST, SUB, 5.15%, 15/10/2037, USD, CONV	7.000,00	57,09%	USD	49,30%	3.243,12	348.364,46	4,3%
BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	500.000,00	108,36%	USD	93,58%	8.921,20	476.845,89	5,9%
CENTENE CORP, 4.25%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL	300.000,00	104,66%	USD	90,38%	3.211,63	274.364,58	3,4%
5. Liquidez					0,00	209.862,61	2,6%
5.1. À Vista						209.862,61	2,6%
Depósitos à Ordem						209.862,61	2,6%
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 MAR22	9,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9. Outros Activos						3.417,26	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores						3.417,26	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						0,01	0,0%
Impostos a Regularizar						3.417,25	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.