

LEVE DUO

30 setembro 2021

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 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					10.333.404,30	811.632.462,45	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					10.333.404,30	811.632.462,45	100,0%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					2.242.242,40	130.352.172,06	16,1%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					1.769.785,16	103.052.916,25	12,7%
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	115,03%	EUR	115,03%	17.149,33	3.467.989,33	0,4%
PGB, 2.2%, 17/10/2022, GOVT	31.000.000,00	102,99%	EUR	102,99%	650.235,91	32.576.515,91	4,0%
PGB, 2.875%, 15/10/2025, GOVT	7.382,78	113,79%	EUR	113,79%	203,53	8.604,62	0,0%
PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT	5.000.000,00	131,46%	EUR	131,46%	120.496,59	6.693.296,59	0,8%
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	31.000.000,00	124,85%	EUR	124,85%	592.078,77	39.295.578,77	4,8%
PGB, 4.95%, 25/10/2023, GOVT	4.000.000,00	111,72%	EUR	111,72%	184.438,36	4.653.398,36	0,6%
PGB, 5.65%, 15/02/2024, GOVT	5.000.000,00	115,06%	EUR	115,06%	175.691,76	5.928.441,76	0,7%
REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	104,00%	EUR	104,00%	29.490,91	10.429.090,91	1,3%
1.1.3. Obrigações Diversas					472.457,24	27.249.261,54	3,4%
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP	9.000.000,00	111,13%	EUR	111,13%	311.123,80	10.312.733,80	1,3%
SAUDACOR, FRN, 20/06/2022, CORP	16.430.000,00	102,10%	EUR	102,10%	161.333,44	16.936.527,74	2,1%
1.1.4. Acções						49.994,27	0,0%
BES, PL	99.815,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
CTT, PL	2.714,00	4,66	EUR	4,66		12.633,67	0,0%
REN, PL	14.680,00	2,55	EUR	2,55		37.360,60	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					6.315.526,20	410.396.094,09	50,6%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					5.934.334,65	341.574.019,25	42,1%
ANDORRA, 0.6%, 14/04/2023, GOVT, CALL	15.000.000,00	100,69%	EUR	100,69%	86.496,79	15.190.146,79	1,9%
BASQUE GOVT, 0.25%, 30/04/2031, GOVT	6.500.000,00	98,65%	EUR	98,65%	6.811,63	6.418.866,63	0,8%
BTPS, 2.45%, 01/10/2023, GOVT	9.000.000,00	105,69%	EUR	105,69%	109.647,56	9.621.297,56	1,2%
BTPS, 2.5%, 01/12/2024, GOVT	5.000.000,00	108,47%	EUR	108,47%	41.325,13	5.464.925,13	0,7%
BTPS, 3.75%, 01/09/2024, GOVT	1.500.000,00	111,57%	EUR	111,57%	4.506,22	1.678.101,22	0,2%
BTPS, 4.5%, 01/05/2023, GOVT	8.200.000,00	107,84%	EUR	107,84%	153.665,79	8.996.135,79	1,1%
BTPS, 4.75%, 01/08/2023, GOVT	32.300.000,00	109,51%	EUR	109,51%	250.149,48	35.622.848,48	4,4%
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	7.000.000,00	129,13%	EUR	129,13%	26.636,75	9.065.876,75	1,1%
BTPS, 5.25%, 01/11/29, GOVT	4.000.000,00	136,97%	EUR	136,97%	88.027,39	5.566.747,39	0,7%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	14.000.000,00	137,08%	EUR	137,08%	378.958,92	19.570.578,92	2,4%
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	106,19%	EUR	106,19%	231.452,05	21.468.452,05	2,6%
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	900.000,00	110,16%	EUR	110,16%	5.926,76	997.402,76	0,1%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	3.000.000,00	97,32%	EUR	97,32%	1.257,53	2.920.977,53	0,4%
SPGB, 0.6%, 31/10/2029, GOVT	5.000.000,00	103,43%	EUR	103,43%	27.452,05	5.198.852,05	0,6%
SPGB, 2.75%, 31/10/2024, GOVT	28.900.000,00	110,03%	EUR	110,03%	727.250,68	32.525.342,68	4,0%
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	23.000.000,00	136,25%	EUR	136,25%	1.083.898,63	32.421.628,63	4,0%
SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT	15.140.000,00	107,98%	EUR	107,98%	542.053,48	16.890.831,08	2,1%
SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT	24.500.000,00	156,06%	EUR	156,06%	239.294,52	38.473.504,52	4,7%
SPGB, 5.9%, 30/07/2026, GOVT	2.000.000,00	130,00%	EUR	130,00%	20.043,84	2.620.023,84	0,3%
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	48.000.000,00	143,65%	EUR	143,65%	1.909.479,45	70.861.479,45	8,7%
1.2.3. Obrigações Diversas					381.191,55	68.822.074,84	8,5%
BANCO SANTANDER, 1.125%, 23/06/2027, CORP	2.500.000,00	104,16%	EUR	104,16%	7.628,42	2.611.678,42	0,3%
BANCO SANTANDER, 3.25%, 04/04/2026, CORP	4.100.000,00	112,41%	EUR	112,41%	65.347,26	4.674.239,26	0,6%
BBVA, 0.375%, 02/10/2024, CORP	3.400.000,00	101,37%	EUR	101,37%	12.680,14	3.459.396,14	0,4%
BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP	2.600.000,00	100,70%	EUR	100,70%	9.224,66	2.627.320,66	0,3%
BNP PARIBAS, 2.875%, 01/10/2026, CORP	2.000.000,00	112,05%	EUR	112,05%	57.342,47	2.298.422,47	0,3%
CAIXABANK, 0.625%, 01/10/2024, CORP	5.000.000,00	101,78%	EUR	101,78%	31.164,38	5.119.964,38	0,6%
CAIXABANK, 1.75%, 24/10/2023, CORP	3.000.000,00	103,92%	EUR	103,92%	49.047,95	3.166.647,95	0,4%
CAIXABANK, 2.375%, 01/02/2024, CORP	3.100.000,00	105,75%	EUR	105,75%	48.612,67	3.326.831,67	0,4%
CARREFOUR SA, CZ, 14/06/2023, CORP, USD, CONV	13.000.000,00	98,60%	USD	85,16%	0,00	11.070.265,14	1,4%
CREDIT AGRICOLE, 2.7%, 15/07/2025, CORP	300.000,00	108,07%	EUR	108,07%	1.694,84	325.889,84	0,0%
CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP	175.000,00	109,84%	EUR	109,84%	880,94	193.099,19	0,0%
CRITERIA CAIXA, 1.375%, 10/04/2024, CORP	2.000.000,00	103,49%	EUR	103,49%	13.034,25	2.082.874,25	0,3%
DELL BANK, 1.625%, 24/06/2024, CORP, CALL	2.000.000,00	104,17%	EUR	104,17%	8.726,03	2.092.206,03	0,3%
ELIS, CZ, 06/10/2023, CORP, CALL, CONV (PAR=31.85)	120.000,00	31,51%	EUR	31,51%	0,00	3.781.560,00	0,5%
EP INFRASTRUCTURE, 1.659%, 26/04/2024, CORP, CALL	4.000.000,00	103,39%	EUR	103,39%	28.543,89	4.164.303,89	0,5%
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	1.050.000,00	100,52%	EUR	100,52%	7.273,44	1.062.722,94	0,1%
FRESENIUS, CZ, 31/01/2024, CORP, CONV	6.600.000,00	100,03%	EUR	100,03%	0,00	6.602.046,00	0,8%
JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, CORP	1.590.000,00	108,20%	EUR	108,20%	9.291,56	1.729.607,96	0,2%
NOKIA, 2.375%, 15/05/2025, CORP, CALL	1.000.000,00	106,35%	EUR	106,35%	8.979,45	1.072.479,45	0,1%
SAMPO OYJ, 1%, 18/09/2023, CORP	2.000.000,00	102,92%	EUR	102,92%	657,54	2.059.057,54	0,3%
SAMPO OYJ, 1.25%, 30/05/2025, CORP, CALL	5.000.000,00	105,61%	EUR	105,61%	21.061,66	5.301.461,66	0,7%

- 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.