

LEVE TRI

30 novembro 2021

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 com referência a 31 outubro 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					2.307,06	5.271.673,68	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					2.307,06	5.271.673,68	100,0%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					0,00	0,00	0,0%
1.1.4. Acções						0,00	0,0%
BANIF, PL	247.226,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
BES, PL	22.523,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					2.307,06	5.271.673,68	100,0%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					2.307,06	1.143.941,17	21,7%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	122.000,00	99,82%	EUR	99,82%	576,33	122.354,29	2,3%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	35.000,00	97,44%	EUR	97,44%	147,93	34.251,58	0,6%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	1.000,00	107,87%	EUR	107,87%	9,95	1.088,66	0,0%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	1.000,00	101,30%	EUR	101,30%	0,00	1.013,02	0,0%
DBR, 0%, 16/09/2022, GOVT	22.000,00	100,61%	EUR	100,61%	0,00	22.135,08	0,4%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	31.000,00	105,73%	EUR	105,73%	61,15	32.836,52	0,6%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	173.000,00	106,44%	EUR	106,44%	253,57	184.396,50	3,5%
DBR, 1.25%, 15/08/2048, GOVT	1.000,00	135,85%	EUR	135,85%	3,66	1.362,16	0,0%
DBR, 1.5%, 15/02/2023, GOVT	30.000,00	102,83%	EUR	102,83%	355,07	31.204,97	0,6%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	100,82%	EUR	100,82%	0,00	36.296,28	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	261.000,00	103,68%	EUR	103,68%	8,94	270.624,18	5,1%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	129.000,00	109,62%	EUR	109,62%	540,74	141.954,41	2,7%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	125.000,00	101,10%	EUR	101,10%	46,23	126.421,23	2,4%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	50.000,00	97,86%	EUR	97,86%	29,32	48.957,82	0,9%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	46.000,00	100,91%	EUR	100,91%	18,90	46.437,50	0,9%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	30.000,00	114,81%	EUR	114,81%	197,14	34.641,04	0,7%
SPGB, 3.45%, 30/07/2066, GOVT	5.000,00	158,16%	EUR	158,16%	58,13	7.965,93	0,2%
1.2.4. Acções						4.127.732,51	78,3%
ADIDAS, GY	119,00	255,85	EUR	255,85		30.446,15	0,6%
ADYEN NV, NA	11,00	2.447,50	EUR	2.447,50		26.922,50	0,5%
AIR LIQUIDE, FP	314,00	145,82	EUR	145,82		45.787,48	0,9%
AIRBUS GROUP, FP	534,00	98,71	EUR	98,71		52.711,14	1,0%
AKZO NOBEL, NA	212,00	92,92	EUR	92,92		19.699,04	0,4%
ALLIANZ, GY	250,00	192,62	EUR	192,62		48.155,00	0,9%
AMADEUS, SA, SM	320,00	56,48	EUR	56,48		18.073,60	0,3%
ANHEUSER-BUSCH INBEV, BB	614,00	49,26	EUR	49,26		30.242,57	0,6%
ASML HOLDING, NA	269,00	699,60	EUR	699,60		188.192,40	3,6%
ASSICURAZIONI GENERALI, IM	662,00	17,73	EUR	17,73		11.737,26	0,2%
AXA, FP	1.286,00	24,35	EUR	24,35		31.307,67	0,6%
BANCA INTESA, IM	9.929,00	2,12	EUR	2,12		21.004,80	0,4%
BANCO SANTANDER, SM	11.590,00	2,75	EUR	2,75		31.872,51	0,6%
BASF, GY	542,00	57,91	EUR	57,91		31.387,22	0,6%
BAYER, GY	1.061,00	44,61	EUR	44,61		47.325,91	0,9%
BBVA, SM	3.204,00	4,70	EUR	4,70		15.066,81	0,3%
BMW, GY	213,00	84,99	EUR	84,99		18.102,87	0,3%
BNP PARIBAS, FP	877,00	55,08	EUR	55,08		48.305,16	0,9%
CELLNEX TELECOM, SM	340,00	52,04	EUR	52,04		17.693,60	0,3%
CREDIT AGRICOLE, FP	1.006,00	12,07	EUR	12,07		12.138,40	0,2%
CRH, ID	534,00	42,92	EUR	42,92		22.919,28	0,4%
DAIMLER, GY	672,00	83,13	EUR	83,13		55.863,36	1,1%
DANONE, FP	488,00	51,99	EUR	51,99		25.371,12	0,5%
DASSAULT, FP	386,00	53,17	EUR	53,17		20.523,62	0,4%
DEUTSCHE BANK, GY	1.666,00	10,70	EUR	10,70		17.826,20	0,3%
DEUTSCHE BOERSE, GY	127,00	139,05	EUR	139,05		17.659,35	0,3%
DEUTSCHE POST, GY	1.349,00	52,43	EUR	52,43		70.728,07	1,3%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	2.424,00	15,68	EUR	15,68		37.998,62	0,7%
DSM, NA	158,00	190,15	EUR	190,15		30.043,70	0,6%
ENEL, IM	4.341,00	6,71	EUR	6,71		29.115,09	0,6%
ENI SPA, IM	549,00	11,64	EUR	11,64		6.390,36	0,1%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	326,00	38,43	EUR	38,43		12.528,18	0,2%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	188,00	177,00	EUR	177,00		33.276,00	0,6%
ESSITY AB, SS, SEK	590,00	288,00	SEK	28,00		16.519,54	0,3%
FERROVIAL, SM	412,00	24,56	EUR	24,56		10.118,72	0,2%
FRESENIUS, GY	405,00	33,55	EUR	33,55		13.585,73	0,3%
HERMES, FP	20,00	1.653,00	EUR	1.653,00		33.060,00	0,6%
IBERDROLA, SM	3.275,00	9,90	EUR	9,90		32.435,60	0,6%
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA, SM	1.084,00	27,86	EUR	27,86		30.200,24	0,6%
INFINEON, GY	489,00	39,89	EUR	39,89		19.503,77	0,4%
ING Groep, NA	2.506,00	12,21	EUR	12,21		30.593,25	0,6%
KBC GROUP NV, BB	242,00	74,02	EUR	74,02		17.912,84	0,3%

Designação		Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
	KERING, FP	54,00	681,30	EUR	681,30		36.790,20	0,7%
	L' OREAL, FP	226,00	397,50	EUR	397,50		89.835,00	1,7%
	LVMH, FP	195,00	686,40	EUR	686,40		133.848,00	2,5%
	MICHELIN, FP	114,00	130,40	EUR	130,40		14.865,60	0,3%
	MUNCHENER RUCK, GY	76,00	239,15	EUR	239,15		18.175,40	0,3%
	NESTE OYJ, FH	227,00	41,98	EUR	41,98		9.529,46	0,2%
	NOKIA, FH	3.791,00	4,95	EUR	4,95		18.774,93	0,4%
	ORANGE, FP	1.300,00	9,51	EUR	9,51		12.363,00	0,2%
	PERNOD-RICARD, FP	226,00	202,50	EUR	202,50		45.765,00	0,9%
	PROSUS NV, NA	375,00	70,90	EUR	70,90		26.587,50	0,5%
	RWE, GY	271,00	34,20	EUR	34,20		9.268,20	0,2%
	SAFRAN, FP	115,00	98,78	EUR	98,78		11.359,70	0,2%
	SAMPO OYJ, FH	425,00	43,31	EUR	43,31		18.406,75	0,3%
	SANOFI-SYNTHELABO, FP	618,00	83,86	EUR	83,86		51.825,48	1,0%
	SAP, GY	645,00	113,98	EUR	113,98		73.517,10	1,4%
	SCHNEIDER, FP	191,00	156,18	EUR	156,18		29.830,38	0,6%
	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, SM	318,00	23,52	EUR	23,52		7.479,36	0,1%
	SIEMENS HEALTHINEERS, GY	434,00	64,68	EUR	64,68		28.071,12	0,5%
	SIEMENS, GY	713,00	142,32	EUR	142,32		101.474,16	1,9%
	SOCIETE GENERALE, FP	676,00	27,55	EUR	27,55		18.620,42	0,4%
	ST.GOBAIN, FP	589,00	56,18	EUR	56,18		33.090,02	0,6%
	TELEFONICA, SM	2.939,00	4,00	EUR	4,00		11.742,77	0,2%
	TELEPERFORMANCE, FP	51,00	362,70	EUR	362,70		18.497,70	0,4%
	TOTALENERGIES SE, FP	1.198,00	40,61	EUR	40,61		48.650,79	0,9%
	UNICREDIT, IM	1.636,00	10,69	EUR	10,69		17.488,84	0,3%
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	490,00	25,31	EUR	25,31		12.399,45	0,2%
	VINCI, FP	402,00	83,66	EUR	83,66		33.631,32	0,6%
	VOLKSWAGEN PFD, GY	103,00	162,00	EUR	162,00		16.686,00	0,3%
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	112.342,86	2,1%
1.3.4.	Acções					0,00	112.342,86	2,1%
	ANGLO AMERICAN, LN, GBP	366,00	27,71	GBP	32,53		11.907,37	0,2%
	OCADO, LN, GBP	749,00	17,96	GBP	21,08		15.789,40	0,3%
	RECKITT BENCKISER, LN, GBP	217,00	61,10	GBP	71,74		15.566,79	0,3%
	STELLANTIS NV, IM	2.843,00	15,14	EUR	15,14		43.043,02	0,8%
	STMICROELECTRONICS, FP	309,00	43,09	EUR	43,09		13.314,81	0,3%
	ZURICH INSURANCE GROUP, VX, CHF	35,00	379,10	CHF	363,47		12.721,48	0,2%
3.	Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	806.178,26	15,3%
3.1.	Fundos Harmonizados					0,00	806.178,26	15,3%
	BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	1.273,30	222,96	EUR	222,96		283.895,41	5,4%
	ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM)	1.710,00	46,15	EUR	46,15		78.907,95	1,5%
	ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM)	806,00	100,12	EUR	100,12		80.696,72	1,5%
	VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	1.594,08	177,95	EUR	177,95		283.666,36	5,4%
	X MSCI JAPAN EUR, FIM	3.140,00	25,16	EUR	25,16		79.011,82	1,5%
4.	Imobiliário					0,00	265.871,24	5,0%
4.2.	Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário					0,00	265.871,24	5,0%
	FUNDIMO (FII)	33.016,00	8,05	EUR	8,05		265.871,24	5,0%
5.	Liquidez					0,00	659.786,06	12,5%
5.1.	À Vista					0,00	659.786,06	12,5%
	Depósitos à Ordem					0,00	659.786,06	12,5%
9.	Outros Activos					0,00	4.635,72	0,1%
9.1.	Outros Devedores E Credores					0,00	4.635,72	0,1%
	Juros de D.O. a Regularizar					0,00	0,11	0,0%
	Transacções a Liquidar					0,00	733,60	0,0%
	Impostos a Regularizar					0,00	11.698,35	0,2%
	Comissões					0,00	-7.796,34	-0,1%
VALOR TOTAL DA CARTEIRA							5.271.673,68	
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO							898.704,06	
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO							5,86586	

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	1,55%
2009	12,13%	10,39%	3 Anos	0,62%
2010	-1,04%	11,06%	5 Anos	0,30%
2011	-7,30%	13,27%	Desde o Inicio	0,64%
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%		

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