

LEVE TRI

30 Setembro 2019

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 30/09/2019, 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					12.069,91	4.982.777,27	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					12.069,91	3.190.051,02	64,0%
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.					12.069,91	3.190.051,02	64,0%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					12.069,91	993.715,31	19,9%
BOTS, CZ, 13/12/2019, GOVT	44.000,00	100,07%	EUR	100,07%	0,00	44.029,04	0,9%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	65.000,00	138,04%	EUR	138,04%	427,40	90.152,10	1,8%
DBR, 1.5%, 15/02/2023, GOVT	10.000,00	107,94%	EUR	107,94%	93,29	10.887,29	0,2%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	304.000,00	104,26%	EUR	104,26%	5.601,10	322.560,62	6,5%
FRTR, 3%, 25/04/2022, GOVT	105.000,00	109,66%	EUR	109,66%	1.359,84	116.504,94	2,3%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	90.000,00	120,43%	EUR	120,43%	3.563,01	111.950,01	2,2%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	15.000,00	101,66%	EUR	101,66%	0,00	15.248,25	0,3%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	27.000,00	111,11%	EUR	111,11%	42,60	30.041,76	0,6%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	225.000,00	102,75%	EUR	102,75%	926,51	232.120,76	4,7%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	17.000,00	118,61%	EUR	118,61%	56,16	20.220,54	0,4%
1.2.4. Acções						2.196.335,71	44,1%
ADIDAS, GY	139,00	285,80	EUR	285,80		39.726,20	0,8%
AENA SA, SM	77,00	167,90	EUR	167,90		12.928,30	0,3%
AIR LIQUIDE, FP	93,00	130,20	EUR	130,20		12.108,60	0,2%
AIRBUS GROUP, FP	407,00	119,24	EUR	119,24		48.530,68	1,0%
AKZO NOBEL, NA	366,00	81,85	EUR	81,85		29.957,10	0,6%
ALLIANZ, GY	394,00	213,20	EUR	213,20		84.000,80	1,7%
AMUNDI, FP	531,00	64,00	EUR	64,00		33.984,00	0,7%
ANGLO AMERICAN, LN, GBP	710,00	18,77	GBP	21,19		15.046,01	0,3%
ASML HOLDING, NA	390,00	226,30	EUR	226,30		88.257,00	1,8%
ATLANTIA, IM	483,00	22,21	EUR	22,21		10.727,43	0,2%
AXA, FP	356,00	23,39	EUR	23,39		8.325,06	0,2%
BANCA INTESA, IM	5.096,00	2,17	EUR	2,17		11.065,96	0,2%
BANCA MEDIOLANUM SPA, IM	2.910,00	6,97	EUR	6,97		20.282,70	0,4%
BANCO SANTANDER, SM	7.850,00	3,73	EUR	3,73		29.304,06	0,6%
BASF, GY	393,00	64,07	EUR	64,07		25.179,51	0,5%
BAYER, GY	888,00	64,75	EUR	64,75		57.498,00	1,2%
BMW, GY	261,00	64,63	EUR	64,63		16.868,43	0,3%
BNP PARIBAS, FP	1.531,00	44,60	EUR	44,60		68.274,95	1,4%
CONTINENTAL, GY	77,00	117,70	EUR	117,70		9.062,90	0,2%
COVESTRO AG, GY	467,00	45,49	EUR	45,49		21.243,83	0,4%
CREDIT AGRICOLE, FP	3.253,00	11,12	EUR	11,12		36.173,36	0,7%
CRH, ID	552,00	31,47	EUR	31,47		17.371,44	0,3%
DAIMLER, GY	668,00	45,63	EUR	45,63		30.480,84	0,6%
DANONE, FP	638,00	80,66	EUR	80,66		51.461,08	1,0%
DEUTSCHE POST, GY	841,00	30,61	EUR	30,61		25.743,01	0,5%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1.694,00	15,40	EUR	15,40		26.090,99	0,5%
DSM, NA	327,00	110,20	EUR	110,20		36.035,40	0,7%
E.ON, GY	1.534,00	8,91	EUR	8,91		13.667,94	0,3%
ENEL, IM	4.342,00	6,86	EUR	6,86		29.781,78	0,6%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	194,00	132,35	EUR	132,35		25.675,90	0,5%
ESSITY AB, SS, SEK	610,00	287,80	SEK	26,91		16.413,73	0,3%
EURONEXT NV, FP	312,00	74,85	EUR	74,85		23.353,20	0,5%
FIAT CHRYSLER, IM	790,00	11,85	EUR	11,85		9.364,66	0,2%
FRESENIUS, GY	373,00	43,05	EUR	43,05		16.055,79	0,3%
HERMES, FP	20,00	632,60	EUR	632,60		12.652,00	0,3%
IBERDROLA, SM	3.092,00	9,52	EUR	9,52		29.429,66	0,6%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	851,00	28,36	EUR	28,36		24.134,36	0,5%
INFORMA PLC, LN, GBP	1.641,00	8,53	GBP	9,63		15.796,20	0,3%
ING Groep, NA	2.215,00	9,59	EUR	9,59		21.241,85	0,4%
INVESTOR AB, SS, SEK	714,00	480,40	SEK	44,91		32.069,19	0,6%
IRISH BANK RESOLUTION, ID	446,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
KERING, FP	56,00	467,65	EUR	467,65		26.188,40	0,5%
KONE, FH	296,00	52,24	EUR	52,24		15.463,04	0,3%
KPN, NA	5.764,00	2,86	EUR	2,86		16.490,80	0,3%
L' OREAL, FP	214,00	257,10	EUR	257,10		55.019,40	1,1%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
LVMH, FP	174,00	363,20	EUR	363,20		63.196,80	1,3%
MASMOVIL IBERCOM, SM	868,00	18,68	EUR	18,68		16.214,24	0,3%
MICHELIN, FP	118,00	102,40	EUR	102,40		12.083,20	0,2%
NESTE OYJ, FH	1.087,00	30,28	EUR	30,28		32.914,36	0,7%
NOKIA, FH	7.114,00	4,65	EUR	4,65		33.044,53	0,7%
OCADO, LN, GBP	1.370,00	13,25	GBP	14,95		20.486,67	0,4%
ORANGE, FP	3.205,00	14,35	EUR	14,35		45.991,75	0,9%
PERNOD-RICARD, FP	203,00	163,35	EUR	163,35		33.160,05	0,7%
PORSCHE, GY	177,00	59,68	EUR	59,68		10.563,36	0,2%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	224,00	63,48	GBP	71,67		16.054,01	0,3%
RENAULT, FP	167,00	52,68	EUR	52,68		8.797,56	0,2%
REPSOL, SM	1.739,00	14,36	EUR	14,36		24.963,35	0,5%
SAFRAN, FP	273,00	144,55	EUR	144,55		39.462,15	0,8%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	647,00	84,79	EUR	84,79		54.859,13	1,1%
SAP, GY	627,00	107,68	EUR	107,68		67.515,36	1,4%
SCHNEIDER, FP	458,00	80,32	EUR	80,32		36.786,56	0,7%
SIEMENS HEALTHINEERS, GY	423,00	36,07	EUR	36,07		15.257,61	0,3%
SIEMENS, GY	636,00	98,21	EUR	98,21		62.461,56	1,3%
ST.GOBAIN, FP	472,00	35,92	EUR	35,92		16.951,88	0,3%
TELECOM ITALIA, IM	35.300,00	0,52	EUR	0,52		18.419,54	0,4%
TELEFONICA, SM	2.290,00	6,99	EUR	6,99		16.004,81	0,3%
THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	106,00	105,60	EUR	105,60		11.193,60	0,2%
TOTAL FINA, FP	1.200,00	47,81	EUR	47,81		57.372,01	1,2%
UNICREDIT, IM	3.719,00	10,82	EUR	10,82		40.254,46	0,8%
UNILEVER, NA	1.657,00	55,15	EUR	55,15		91.383,55	1,8%
VINCI, FP	489,00	98,52	EUR	98,52		48.176,28	1,0%
VOLKSWAGEN PFD, GY	160,00	156,18	EUR	156,18		24.988,80	0,5%
WIRECARD AG, GY	199,00	147,00	EUR	147,00		29.253,00	0,6%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo						1.092.483,76	21,9%
3.1. Fundos Harmonizados						1.092.483,76	21,9%
CAIXAGEST OBRIGAÇÕES, FIM	90.700,00	4,48	EUR	4,48		406.562,75	8,2%
DB X-TRACKERS II EUROPE 5Y ETF, FIM	837,00	120,09	EUR	120,09		100.511,15	2,0%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	2.408,00	140,51	EUR	140,51		338.348,08	6,8%
ISHARES US TREASURY BOND ETF	10.233,00	26,29	USD	24,14		247.061,78	5,0%
4. Imobiliário						1.699,43	0,0%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário						1.699,43	0,0%
CAIXAGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	424,00	4,01	EUR	4,01		1.699,43	0,0%
5. Liquidez						810.924,99	16,3%
5.1. À Vista						810.924,99	16,3%
Depósitos à Ordem						810.924,99	16,3%
9. Outros Activos						-112.381,94	-2,3%
9.1. Outros Devedores E Credores						-112.381,94	-2,3%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	1,57	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	673,20	0,0%
Impostos a Regularizar					0,00	13.618,58	0,3%
Comissões					0,00	-126.675,29	-2,5%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

4.982.777,27

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

943.509,64

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

5,28111

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, numa percentagem mínima de 40% e máxima de 55%;
- 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.
- e) 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	-9,19%
2009	12,13%	10,39%	3 Anos	-3,28%
2010	-1,04%	11,06%	5 Anos	-0,56%
2011	-7,30%	13,27%	Desde o Inicio	-0,24%
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%		

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

Não se apresentam valores referentes ao ano de 2019, na medida em que o período em análise é inferior a doze meses.