

LEVE TRI

31 dezembro 2020

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 31/12/2020, 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					6.085,36	4.997.908,94	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					6.085,36	3.112.217,23	62,3%
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.					6.085,36	4.997.908,94	100,0%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					6.085,36	838.537,10	16,8%
BTPS, 2%, 01/12/2025, GOVT	40.000,00	110,21%	EUR	110,21%	65,93	44.149,13	0,9%
BTPS, 3.45%, 01/03/2048, GOVT	44.000,00	147,42%	EUR	147,42%	503,23	65.365,83	1,3%
BTPS, 4%, 01/02/2037, GOVT	30.000,00	144,60%	EUR	144,60%	499,73	43.879,13	0,9%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	34.000,00	107,54%	EUR	107,54%	74,32	36.639,28	0,7%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	5.000,00	108,22%	EUR	108,22%	9,44	5.420,59	0,1%
DBR, 2.5%, 04/01/2021, GOVT	139.000,00	100,00%	EUR	100,00%	3.437,02	142.439,80	2,8%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	104,15%	EUR	104,15%	0,00	37.492,56	0,8%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	135.000,00	105,10%	EUR	105,10%	33,29	141.919,64	2,8%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	75.000,00	114,16%	EUR	114,16%	585,10	86.202,10	1,7%
IRISH, 0%, 18/10/2022, GOVT	15.000,00	101,27%	EUR	101,27%	0,00	15.190,20	0,3%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	125.000,00	101,89%	EUR	101,89%	94,01	127.456,51	2,6%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	47.000,00	118,63%	EUR	118,63%	386,69	56.143,73	1,1%
SPGB, 4.7%, 30/07/2041, GOVT	20.000,00	179,21%	EUR	179,21%	396,60	36.238,60	0,7%
1.2.4. Acções						4.159.371,84	83,2%
ADIDAS, GY	132,00	298,80	EUR	298,80		39.441,60	0,8%
AIR LIQUIDE, FP	330,00	134,25	EUR	134,25		44.302,50	0,9%
AIRBUS GROUP, FP	594,00	89,78	EUR	89,78		53.329,32	1,1%
AKZO NOBEL, NA	235,00	87,86	EUR	87,86		20.647,10	0,4%
ALLIANZ, GY	156,00	201,95	EUR	201,95		31.504,20	0,6%
AMADEUS, SA, SM	319,00	59,56	EUR	59,56		18.999,64	0,4%
ANGLO AMERICAN, LN, GBP	576,00	24,25	GBP	26,97		15.533,54	0,3%
ANHEUSER-BUSCH INBEV, BB	682,00	57,01	EUR	57,01		38.880,82	0,8%
ASML HOLDING, NA	324,00	397,55	EUR	397,55		128.806,20	2,6%
AXA, FP	587,00	19,51	EUR	19,51		11.452,37	0,2%
BANCO SANTANDER, SM	17.195,00	2,54	EUR	2,54		43.640,91	0,9%
BASF, GY	602,00	64,67	EUR	64,67		38.931,34	0,8%
BAYER, GY	1.203,00	48,46	EUR	48,46		58.297,38	1,2%
BMW, GY	571,00	72,65	EUR	72,65		41.483,15	0,8%
BNP PARIBAS, FP	1.228,00	43,11	EUR	43,11		52.932,94	1,1%
BOUYGUES, FP	419,00	33,65	EUR	33,65		14.099,35	0,3%
CREDIT AGRICOLE, FP	2.953,00	10,32	EUR	10,32		30.474,96	0,6%
CRH, ID	594,00	34,02	EUR	34,02		20.207,88	0,4%
DAIMLER, GY	396,00	58,21	EUR	58,21		23.051,16	0,5%
DANONE, FP	542,00	53,76	EUR	53,76		29.137,92	0,6%
DASSAULT, FP	95,00	166,15	EUR	166,15		15.784,25	0,3%
DEUTSCHE BANK, GY	3.616,00	8,97	EUR	8,97		32.449,98	0,6%
DEUTSCHE POST, GY	1.499,00	40,69	EUR	40,69		60.994,31	1,2%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	3.512,00	15,03	EUR	15,03		52.767,80	1,1%
DSM, NA	176,00	140,80	EUR	140,80		24.780,80	0,5%
E.ON, GY	1.651,00	9,09	EUR	9,09		15.010,89	0,3%
ENEL, IM	4.673,00	8,28	EUR	8,28		38.673,75	0,8%
ENI SPA, IM	1.063,00	8,55	EUR	8,55		9.086,52	0,2%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	1.228,00	24,94	EUR	24,94		30.626,32	0,6%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	209,00	127,55	EUR	127,55		26.657,95	0,5%
ESSITY AB, SS, SEK	656,00	265,60	SEK	26,47		17.363,80	0,3%
FERROVIAL, SM	458,00	22,60	EUR	22,60		10.350,80	0,2%
FIAT CHRYSLER, IM	1.224,00	14,66	EUR	14,66		17.943,84	0,4%
FRESENIUS, GY	491,00	38,16	EUR	38,16		18.736,56	0,4%
HERMES, FP	22,00	879,60	EUR	879,60		19.351,20	0,4%
IBERDROLA, SM	3.327,00	11,70	EUR	11,70		38.925,90	0,8%
ILIAD, FP	150,00	168,05	EUR	168,05		25.207,50	0,5%
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA, SM	1.205,00	26,04	EUR	26,04		31.378,20	0,6%
INFINEON, GY	818,00	31,56	EUR	31,56		25.816,08	0,5%
IRISH BANK RESOLUTION, ID	446,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
KBC GROUP NV, BB	675,00	57,28	EUR	57,28		38.664,00	0,8%
KERING, FP	60,00	594,40	EUR	594,40		35.664,00	0,7%
L' OREAL, FP	251,00	310,80	EUR	310,80		78.010,80	1,6%
LVMH, FP	230,00	510,90	EUR	510,90		117.507,00	2,4%
MICHELIN, FP	127,00	104,95	EUR	104,95		13.328,65	0,3%
NESTE OYJ, FH	285,00	59,34	EUR	59,34		16.911,90	0,3%
NOKIA, FH	2.689,00	3,16	EUR	3,16		8.490,52	0,2%
OCADO, LN, GBP	833,00	22,73	GBP	25,28		21.060,59	0,4%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
PERNOD-RICARD, FP	251,00	156,80	EUR	156,80		39.356,80	0,8%
PROSUS NV, NA	384,00	88,36	EUR	88,36		33.930,24	0,7%
PSA PEUGEOT, FP	1.369,00	22,37	EUR	22,37		30.624,53	0,6%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	241,00	65,42	GBP	72,77		17.536,92	0,4%
REPSOL, SM	1.001,00	8,25	EUR	8,25		8.258,25	0,2%
SAFRAN, FP	128,00	115,95	EUR	115,95		14.841,60	0,3%
SAMPO OYJ, FH	1.164,00	34,69	EUR	34,69		40.379,16	0,8%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	764,00	78,70	EUR	78,70		60.126,80	1,2%
SAP, GY	693,00	107,48	EUR	107,48		74.483,64	1,5%
SCHNEIDER, FP	212,00	118,30	EUR	118,30		25.079,60	0,5%
SIEMENS ENERGY AG, GY	396,00	30,25	EUR	30,25		11.979,00	0,2%
SIEMENS HEALTHINEERS, GY	483,00	42,33	EUR	42,33		20.442,98	0,4%
SIEMENS, GY	793,00	117,92	EUR	117,92		93.510,56	1,9%
ST.GOBAIN, FP	655,00	37,50	EUR	37,50		24.562,50	0,5%
TELECOM ITALIA, IM	34.217,00	0,38	EUR	0,38		12.913,50	0,3%
TELEFONICA, SM	2.906,00	3,24	EUR	3,24		9.427,06	0,2%
TELEPERFORMANCE, FP	57,00	271,30	EUR	271,30		15.464,10	0,3%
TOTAL FINA, FP	1.882,00	35,30	EUR	35,30		66.425,19	1,3%
UNICREDIT, IM	3.410,00	7,65	EUR	7,65		26.079,68	0,5%
VINCI, FP	447,00	81,36	EUR	81,36		36.367,92	0,7%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	15.191,93	0,3%
1.3.4. Acções					0,00	15.191,93	0,3%
ZURICH INSURANCE GROUP, VX, CHF	44,00	372,96	CHF	345,27		15.191,93	0,3%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	1.228.149,46	24,6%
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	1.228.149,46	24,6%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	1.223,00	223,97	EUR	223,97		273.915,31	5,5%
ISHARES EURO CORPORATE (FIM)	1.928,00	142,07	EUR	142,07		273.910,96	5,5%
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM)	2.010,00	39,83	EUR	39,83		80.058,30	1,6%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM)	653,00	81,30	EUR	81,30		53.088,90	1,1%
ISHARES USD CORP BND EUR-H D (FIM)	23.422,00	5,27	EUR	5,27		123.445,65	2,5%
NORDEA 1 EUR GHG YLD-BI-EUR	3.817,00	39,18	EUR	39,18		149.550,06	3,0%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	1.529,00	179,32	EUR	179,32		274.180,28	5,5%
4. Imobiliário					0,00	1.709,14	0,0%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário					0,00	1.709,14	0,0%
CAIXAGEST IMOBILIÁRIO INTERNACIONAL, FII	424,00	4,03	EUR	4,03		1.709,14	0,0%
5. Liquidez					0,00	653.555,32	13,1%
5.1. À Vista					0,00	653.555,32	13,1%
Depósitos à Ordem					0,00	653.555,32	13,1%
9. Outros Activos					0,00	2.277,78	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	2.277,78	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	0,11	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	233,51	0,0%
Impostos a Regularizar					0,00	9.477,80	0,2%
Comissões					0,00	-7.433,64	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

4.997.908,94
916.284,84
5,45454

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 rendibilidade futura.