

LEVE DUO

31 março 2022

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 31 março 2022, 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						7.868.412,73	710.932.876,85	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados						7.868.412,73	710.932.876,85	100,0%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal						1.700.969,50	93.033.813,62	13,1%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública						1.498.349,49	66.433.733,24	9,3%
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT		3.000.000,00	105,93%	EUR	105,93%	46.319,21	3.224.279,21	0,5%
PGB, 2.875%, 15/10/2025, GOVT		7.382,78	108,41%	EUR	108,41%	97,11	8.100,86	0,0%
PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT		5.000.000,00	120,88%	EUR	120,88%	23.356,17	6.067.256,17	0,9%
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT		31.000.000,00	116,97%	EUR	116,97%	1.229.702,07	37.489.782,07	5,3%
PGB, 4.95%, 25/10/2023, GOVT		4.000.000,00	107,81%	EUR	107,81%	85.167,12	4.397.607,12	0,6%
PGB, 5.65%, 15/02/2024, GOVT		5.000.000,00	110,36%	EUR	110,36%	34.054,79	5.551.854,79	0,8%
REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT		10.000.000,00	96,15%	EUR	96,15%	79.653,02	9.694.853,02	1,4%
1.1.3. Obrigações Diversas						202.620,01	26.546.089,21	3,7%
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP		9.000.000,00	108,97%	EUR	108,97%	41.286,57	9.848.946,57	1,4%
REGIAO AUTONOMA ACORES, FRN, 20/06/2022, CORP		16.430.000,00	100,64%	EUR	100,64%	161.333,44	16.697.142,64	2,3%
1.1.4. Acções							53.991,17	0,0%
BES, PL		99.815,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
CTT, PL		2.714,00	4,51	EUR	4,51		12.226,57	0,0%
REN, PL		14.680,00	2,85	EUR	2,85		41.764,60	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.						4.117.361,49	363.243.203,50	51,1%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública						3.652.017,17	310.144.134,97	43,6%
BTPS, 0.35%, 17/11/2028, GOVT		2.000.000,00	95,19%	EUR	95,19%	2.591,16	1.906.391,16	0,3%
BTPS, 2.45%, 01/10/2023, GOVT		9.000.000,00	103,61%	EUR	103,61%	109.644,24	9.434.364,24	1,3%
BTPS, 2.5%, 01/12/2024, GOVT		5.000.000,00	104,81%	EUR	104,81%	41.208,78	5.281.758,78	0,7%
BTPS, 3.75%, 01/09/2024, GOVT		1.500.000,00	107,62%	EUR	107,62%	4.585,60	1.618.855,60	0,2%
BTPS, 4.5%, 01/05/2023, GOVT		8.200.000,00	105,09%	EUR	105,09%	152.900,56	8.769.952,56	1,2%
BTPS, 4.75%, 01/08/2023, GOVT		32.300.000,00	106,45%	EUR	106,45%	245.819,12	34.630.138,12	4,9%
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT		14.000.000,00	119,69%	EUR	119,69%	54.211,96	16.810.251,96	2,4%
BTPS, 5.25%,01/11/29, GOVT		4.000.000,00	126,61%	EUR	126,61%	87.596,67	5.152.036,67	0,7%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT		14.000.000,00	127,64%	EUR	127,64%	377.071,80	18.246.111,80	2,6%
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT		20.000.000,00	100,86%	EUR	100,86%	111.123,29	20.282.523,29	2,9%
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT		900.000,00	102,83%	EUR	102,83%	12.976,89	938.437,89	0,1%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT		3.000.000,00	89,93%	EUR	89,93%	2.753,42	2.700.743,42	0,4%
SPGB, 0.6%, 31/10/2029, GOVT		5.000.000,00	96,58%	EUR	96,58%	12.410,96	4.841.310,96	0,7%
SPGB, 2.75%, 31/10/2024, GOVT		28.900.000,00	106,44%	EUR	106,44%	328.786,99	31.088.501,99	4,4%
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT		23.000.000,00	126,27%	EUR	126,27%	490.026,03	29.531.436,03	4,2%
SPGB, 5.4%, 31/01/2023, GOVT		15.140.000,00	104,85%	EUR	104,85%	132.153,53	16.005.989,33	2,3%
SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT		24.500.000,00	142,44%	EUR	142,44%	941.739,73	35.838.314,73	5,0%
SPGB, 5.9%, 30/07/2026, GOVT		2.000.000,00	122,15%	EUR	122,15%	78.882,19	2.521.962,19	0,4%
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT		48.000.000,00	133,50%	EUR	133,50%	465.534,25	64.545.054,25	9,1%
1.2.3. Obrigações Diversas						465.344,32	53.099.068,53	7,5%
ACCOR, 2.375%, 29/11/2028, CORP, CALL		3.500.000,00	95,90%	EUR	95,90%	27.784,25	3.384.109,25	0,5%
BANCO SANTANDER, 1.125%, 23/06/2027, CORP		2.500.000,00	97,48%	EUR	97,48%	21.652,40	2.458.752,40	0,3%
BANCO SANTANDER, 3.25%, 04/04/2026, CORP		4.100.000,00	105,96%	EUR	105,96%	131.789,73	4.476.067,73	0,6%
BBVA, 0.375%, 02/10/2024, CORP		400.000,00	98,89%	EUR	98,89%	739,73	396.303,73	0,1%
BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP		2.600.000,00	95,11%	EUR	95,11%	2.706,85	2.475.644,85	0,3%
BNP PARIBAS, 2.875%, 01/10/2026, CORP		2.000.000,00	104,20%	EUR	104,20%	28.513,70	2.112.533,70	0,3%
CAIXABANK, 0.625%, 01/10/2024, CORP		5.000.000,00	98,61%	EUR	98,61%	15.496,58	4.945.746,58	0,7%
CAIXABANK, 1.75%, 24/10/2023, CORP		3.000.000,00	102,03%	EUR	102,03%	22.726,03	3.083.686,03	0,4%
CAIXABANK, 2.375%, 01/02/2024, CORP		3.100.000,00	103,03%	EUR	103,03%	11.699,32	3.205.691,32	0,5%
CARREFOUR SA, CZ, 14/06/2023, CORP, USD, CONV		10.400.000,00	97,01%	USD	87,39%	0,00	9.088.312,76	1,3%
CREDIT AGRICOLE, 2.7%, 15/07/2025, CORP		300.000,00	102,93%	EUR	102,93%	1.687,50	310.462,50	0,0%
CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP		175.000,00	103,61%	EUR	103,61%	872,81	182.195,56	0,0%
CRITERIA CAIXA, 1.375%, 10/04/2024, CORP		2.000.000,00	101,05%	EUR	101,05%	26.746,58	2.047.666,58	0,3%
ELIS, CZ, 06/10/2023, CORP, CALL, CONV (PAR=31.85)		15.000,00	31,11%	EUR	31,11%	0,00	466.575,00	0,1%
EP INFRASTRUCTURE, 1.659%, 26/04/2024, CORP, CALL		4.000.000,00	87,93%	EUR	87,93%	61.632,99	3.578.632,99	0,5%
FAURECIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL		1.050.000,00	89,25%	EUR	89,25%	7.273,44	944.398,44	0,1%
FRESENIUS, CZ, 31/01/2024, CORP, CONV		100.000,00	98,36%	EUR	98,36%	0,00	98.364,00	0,0%
JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, GOVT		1.590.000,00	100,95%	EUR	100,95%	20.344,27	1.625.496,97	0,2%
NOKIA, 2.375%, 15/05/2025, CORP, CALL		1.000.000,00	101,74%	EUR	101,74%	20.821,92	1.038.211,92	0,1%
SAMPO OYJ, 1%, 18/09/2023, CORP		2.000.000,00	101,51%	EUR	101,51%	10.630,15	2.040.890,15	0,3%
SAMPO OYJ, 1.25%, 30/05/2025, CORP, CALL		5.000.000,00	101,74%	EUR	101,74%	52.226,07	5.139.326,07	0,7%

Designação		Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					2.050.081,74	206.856.690,24	29,1%
1.3.3.	Obrigações Diversas					2.050.081,74	204.778.423,37	28,8%
	ALEXANDER FUND, 1.841%, 15/11/2023, CORP, USD, CALL, 144A	5.000.000,00	96,94%	USD	87,32%	31.325,51	4.397.463,70	0,6%
	AMC NETWORKS, 5%, 01/04/2024, CORP, USD, CALL	513.261,00	100,00%	USD	90,08%	11.494,68	473.850,32	0,1%
	AMERICAN AIRLINES, 4.375%, 01/10/2022 (EXT DT 2024) CORP, SINK, USD	6.622.851,80	99,01%	USD	89,19%	130.506,16	6.037.498,13	0,8%
	AMERICAN AIRLINES, 4.4%, 22/09/2023 (EXT DT 2025) CORP, SINK, USD	3.291.441,44	96,60%	USD	87,02%	3.261,49	2.867.417,44	0,4%
	AMG CAPITAL TRUST, SUB , 5.15%, 15/10/2037, USD, CONV	203.200,00	54,54%	USD	49,13%	99.506,15	10.083.049,25	1,4%
	ASSTEAD, 4%, 01/05/2028, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	98,55%	USD	88,77%	30.027,32	1.805.488,99	0,3%
	ATHENE GLOBAL FUNDING, 1.875%, 23/06/2023, CORP	2.000.000,00	101,74%	EUR	101,74%	28.869,86	2.063.709,86	0,3%
	BARCLAYS, 3%, 08/05/2026, CORP, GBP	2.000.000,00	99,43%	GBP	117,53%	63.542,10	2.414.177,48	0,3%
	BBVA BANCOMER TEXAS, 4.375%, 10/04/2024, CORP, USD	11.500.000,00	102,29%	USD	92,14%	215.281,84	10.811.629,02	1,5%
	BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL	400.000,00	104,37%	EUR	104,37%	376,99	417.844,99	0,1%
	BOEING CO, 4.875%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	103,27%	USD	93,03%	36.595,80	1.897.112,87	0,3%
	CANARY WHARF, 2.625%, 23/04/2025, CORP, GBP, CALL	4.300.000,00	96,94%	GBP	114,59%	58.283,94	4.985.582,24	0,7%
	CDK GLOBAL, 4.875%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	101,07%	USD	91,04%	14.638,32	925.069,82	0,1%
	CGNPC INTERN, 3.75%, 11/12/2027, CORP, USD	4.464.000,00	99,06%	USD	89,23%	46.076,94	4.029.415,81	0,6%
	CGNPC INTERNATIONAL LTD, 2%, 11/09/2025, CORP	2.000.000,00	101,40%	EUR	101,40%	22.027,40	2.050.007,40	0,3%
	CHINA CINDA FINANCE 2017, 4.1%, 09/03/2024, CORP, USD	10.000.000,00	100,75%	USD	90,76%	22.570,54	9.098.149,31	1,3%
	CHN CLEAN ENERGY DEVELOP, 4%, 05/11/2025, CORP, USD	1.450.000,00	100,85%	USD	90,84%	21.189,28	1.338.428,27	0,2%
	CNAC HK, 1.75%, 14/06/2022, CORP	2.000.000,00	100,05%	EUR	100,05%	27.808,22	2.028.868,22	0,3%
	CNAC HK, 3.5%, 19/07/2022, CORP, USD	2.000.000,00	100,23%	USD	90,29%	12.611,47	1.818.358,70	0,3%
	CNOOC CURTIS FUND, 4.5%, 03/10/2023, CORP, USD	4.000.000,00	102,27%	USD	92,12%	80.172,96	3.765.102,25	0,5%
	COLONY NORTHSTAR, 5%, 15/04/2023, CORP, USD, CONV	8.000.000,00	100,99%	USD	90,97%	166.151,20	7.444.054,09	1,0%
	CORNWALL JERSEY, 0.75%, 16/04/2026, CORP, GBP, CALL, CONV	1.500.000,00	78,84%	GBP	93,20%	6.064,77	1.404.037,46	0,2%
	CSSC CAPITAL, 1.75%, 27/09/2023, CORP	8.300.000,00	100,00%	EUR	100,00%	73.619,86	8.373.536,86	1,2%
	DRAX, 6.625%, 01/11/2025, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	101,34%	USD	91,29%	37.299,57	1.406.581,61	0,2%
	EBAY, 3.45%, 01/08/2024, CORP, USD, CALL	5.000.000,00	101,26%	USD	91,22%	25.898,57	4.586.793,99	0,6%
	ENERGY TRANSFER OPER, 5.5%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL	1.800.000,00	107,16%	USD	96,53%	29.727,06	1.767.251,61	0,2%
	ENERGY TRANSFER, 4.2%, 15/04/2027, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	101,62%	USD	91,54%	34.891,76	1.865.699,80	0,3%
	FREEPORT-MCMORAN INC, 4.125%, 01/03/2028, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	99,97%	USD	90,05%	3.096,57	903.637,06	0,1%
	FRESNILLO, 5.5%, 13/11/2023, CORP, USD	333.000,00	104,48%	USD	94,12%	6.324,43	319.745,19	0,0%
	FUQING INV, 3.25%, 23/06/2025, CORP, USD	30.000.000,00	90,36%	USD	81,40%	239.092,63	24.658.514,31	3,5%
	HAITONG INTL SECURITIES, 2.125%, 02/07/2023, CORP, USD	10.000.000,00	98,45%	USD	88,68%	47.324,32	8.915.624,47	1,3%
	HAITONG SECURITIES, FRN, 13/12/2023, CORP	2.200.000,00	100,59%	EUR	100,59%	1.189,53	2.214.235,53	0,3%
	HCA, 5.625%, 01/09/2028, CORP, USD, CALL	3.100.000,00	108,10%	USD	97,38%	13.090,04	3.031.882,94	0,4%
	HESS, 3.5%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	100,77%	USD	90,78%	13.312,11	1.828.824,23	0,3%
	INT CONSOLIDATED AIRLINE, 0.625%, 17/11/2022, CONV	17.600.000,00	98,33%	EUR	98,33%	40.718,25	17.347.502,25	2,4%
	INTERNATIONAL GAME TECH, 3.5%, 15/06/2026, CORP, CALL	1.100.000,00	100,69%	EUR	100,69%	11.336,11	1.118.926,11	0,2%
	INTL CONSOL AIRLINES, 0.5%, 04/07/2023, CORP, CALL	7.000.000,00	97,16%	EUR	97,16%	25.890,41	6.827.230,41	1,0%
	IQVIA, 5%, 15/10/2026, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	101,83%	USD	91,73%	62.306,70	2.814.329,04	0,4%
	LADBROKES GROUP, 5.125%, 16/09/2022, CORP, GBP	764.000,00	100,63%	GBP	118,96%	1.886,63	910.702,99	0,1%
	LITHIA MOTORS, 4.625%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL 144A	2.000.000,00	99,58%	USD	89,71%	24.534,82	1.818.661,48	0,3%
	LLOYDS BANKING GROUP, 4.5%, 04/11/2024, CORP, USD	2.000.000,00	102,26%	USD	92,12%	33.105,13	1.875.515,72	0,3%
	MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL	3.000.000,00	104,57%	USD	94,19%	46.748,78	2.872.575,29	0,4%
	MEITUAN, 2.125%, 28/10/2025, CORP, USD, CALL	200.000,00	88,64%	USD	79,85%	1.627,11	161.326,24	0,0%
	MET LIFE, 0.375%, 09/04/2024, CORP	5.000.000,00	99,25%	EUR	99,25%	18.287,67	4.980.737,67	0,7%
	MPT OPER, 3.325%, 24/03/2025, CORP, CALL	1.000.000,00	103,52%	EUR	103,52%	637,67	1.035.847,67	0,1%
	NEXTRA ENERGY OP, 4.25%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	101,26%	USD	91,22%	24.247,07	2.760.811,34	0,4%
	NISSAN MOTOR, 2.652%, 17/03/2026, CORP, CALL	1.500.000,00	100,79%	EUR	100,79%	1.525,81	1.513.390,81	0,2%
	PHILIP MORRIS, 0.625%, 08/11/2024, CORP, CALL	3.700.000,00	98,61%	EUR	98,61%	9.059,93	3.657.740,93	0,5%
	SINOCHEM OFFSHORE, 1.625%, 29/10/2025, CORP, USD	1.000.000,00	93,04%	USD	83,81%	6.139,96	844.280,67	0,1%
	TOWER BERSAMA, 2.75%, 20/01/2026, CORP, CALL, USD	1.800.000,00	96,47%	USD	86,90%	8.794,25	1.572.966,85	0,2%
	TRITON CONTAINER, 2.05%, 15/04/2026, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	93,30%	USD	84,04%	17.030,48	1.697.924,09	0,2%
	UAL 2007, 6.636%, 02/07/2022 (EXT DT 2024), CORP, SINK, USD	474.851,37	101,09%	USD	91,07%	7.017,61	439.444,19	0,1%
	UNITED RENTALS, 4.875%, 15/01/2028, CORP, USD, CALL	2.500.000,00	101,60%	USD	91,52%	23.177,35	2.311.191,95	0,3%
	UTAH ACQUISITION SUB, 2.25%, 22/11/2024, CORP, CALL	1.000.000,00	101,54%	EUR	101,54%	7.952,05	1.023.392,05	0,1%
	ZHEJIANG SEAPORT, 1.98%, 17/03/2026, CORP, USD	2.000.000,00	94,60%	USD	85,22%	1.387,26	1.705.738,22	0,2%
	ZHONGSHENG, 3%, 13/01/2026, CORP, USD, CALL	4.000.000,00	95,36%	USD	85,90%	23.421,30	3.459.544,18	0,5%
1.3.4.	Acções					0,00	2.078.266,87	0,3%
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL, HK, HKD	5.884.000,00	3,07	HKD	0,35		2.078.266,87	0,3%
3.	Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	46.368.486,25	6,5%
3.1.	Fundos Harmonizados					0,00	46.368.486,25	6,5%
	ISHARES CORE EURO CORP BOND (FIM)	319.842,00	126,43	EUR	126,43		40.437.624,06	5,7%
	ISHARES EUR CORP BBB-BB (FIM)	1.203.625,00	4,93	EUR	4,93		5.930.862,19	0,8%
5.	Liquidez					0,00	1.346.036,24	0,2%
5.1.	À Vista					0,00	1.346.036,24	0,2%
	Depósitos à Ordem					0,00	1.346.036,24	0,2%
7.	Operações Com Produtos Derivados					0,00	0,00	0,0%
7.1.	Em Mercado Regulamentado					0,00	0,00	0,0%
7.1.1.	Futuros					0,00	0,00	0,0%
	EURGBP FX CURR FUT JUN22	80,00	0,00	GBP	0,00		0,00	0,0%
	EURUSD FX CURR FUT JUN22	1.211,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9.	Outros Activos					0,00	84.647,00	0,0%
9.1.	Outros Devedores E Credores					0,00	84.647,00	0,0%
	Juros de D.O. a Regularizar					0,00	0,19	0,0%
	Impostos a Regularizar					0,00	84.646,81	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:

- 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, até ao máximo de 40%;

- 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.