

LEVE TRI

31 março 2022

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 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					4.000,60	4.944.609,32	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					4.000,60	4.944.609,32	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.					4.000,60	4.944.609,32	100,0%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					4.000,60	1.077.559,36	21,8%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	37.000,00	90,92%	EUR	90,92%	115,88	33.755,91	0,7%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	35.000,00	85,05%	EUR	85,05%	48,51	29.814,26	0,6%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	100.000,00	91,10%	EUR	91,10%	0,00	91.101,00	1,8%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	82.000,00	83,01%	EUR	83,01%	0,00	68.067,38	1,4%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	110.000,00	100,55%	EUR	100,55%	343,56	110.952,96	2,2%
DBR, 1.5%, 15/02/2023, GOVT	75.000,00	101,78%	EUR	101,78%	135,62	76.469,12	1,5%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	92,07%	EUR	92,07%	0,00	33.144,84	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	240.000,00	98,68%	EUR	98,68%	207,12	237.036,72	4,8%
FRTR, 4.25%, 25/10/2023, GOVT	129.000,00	106,92%	EUR	106,92%	2.358,23	140.290,19	2,8%
SPGB, 0.45%, 31/10/2022, GOVT	125.000,00	100,55%	EUR	100,55%	232,71	125.915,21	2,5%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	50.000,00	89,79%	EUR	89,79%	45,89	44.940,39	0,9%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	46.000,00	92,13%	EUR	92,13%	95,15	42.474,03	0,9%
SPGB, 1.9%, 31/10/2052, GOVT	12.000,00	94,87%	EUR	94,87%	26,86	11.410,78	0,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	30.000,00	105,99%	EUR	105,99%	391,07	32.186,57	0,7%
1.2.4. Acções						3.867.049,96	78,2%
ADIDAS, GY	116,00	212,80	EUR	212,80		24.684,80	0,5%
AHOLD DELHAIZE, NA	940,00	29,20	EUR	29,20		27.443,30	0,6%
AIR LIQUIDE, FP	362,00	158,90	EUR	158,90		57.521,80	1,2%
AIRBUS GROUP, FP	458,00	110,90	EUR	110,90		50.792,20	1,0%
AKZO NOBEL, NA	202,00	78,46	EUR	78,46		15.848,92	0,3%
ALLIANZ, GY	156,00	216,55	EUR	216,55		33.781,80	0,7%
AMADEUS, SA, SM	449,00	59,62	EUR	59,62		26.769,38	0,5%
ASML HOLDING, NA	277,00	614,90	EUR	614,90		170.327,30	3,4%
ASR NEDERLAND NV, NA	652,00	42,25	EUR	42,25		27.547,00	0,6%
ASSICURAZIONI GENERALI, IM	1.014,00	20,77	EUR	20,77		21.060,78	0,4%
AXA, FP	441,00	26,63	EUR	26,63		11.743,83	0,2%
BANCO SANTANDER, SM	3.464,00	3,12	EUR	3,12		10.793,82	0,2%
BASF, GY	597,00	51,93	EUR	51,93		31.002,21	0,6%
BAYER, GY	741,00	62,08	EUR	62,08		46.001,28	0,9%
BMW, GY	207,00	78,87	EUR	78,87		16.326,09	0,3%
BNP PARIBAS, FP	501,00	51,88	EUR	51,88		25.991,88	0,5%
CAIXABANK SA, SM	11.823,00	3,09	EUR	3,09		36.485,78	0,7%
CAP GEMINI, FP	203,00	202,60	EUR	202,60		41.127,80	0,8%
CARREFOUR, FP	854,00	19,65	EUR	19,65		16.776,83	0,3%
CRH, ID	680,00	36,50	EUR	36,50		24.820,00	0,5%
DANONE, FP	305,00	50,15	EUR	50,15		15.295,75	0,3%
DEUTSCHE BOERSE, GY	175,00	163,90	EUR	163,90		28.682,50	0,6%
DEUTSCHE POST, GY	830,00	43,69	EUR	43,69		36.258,55	0,7%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	2.686,00	17,01	EUR	17,01		45.688,86	0,9%
DSM, NA	68,00	163,75	EUR	163,75		11.135,00	0,2%
E.ON, GY	1.452,00	10,54	EUR	10,54		15.306,98	0,3%
ENEL, IM	4.480,00	6,11	EUR	6,11		27.372,80	0,6%
ENI SPA, IM	897,00	13,28	EUR	13,28		11.913,95	0,2%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	1.011,00	33,33	EUR	33,33		33.696,63	0,7%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	159,00	167,22	EUR	167,22		26.587,98	0,5%
ESSITY AB, SS, SEK	508,00	222,20	SEK	21,50		10.919,76	0,2%
FERROVIAL, SM	428,00	24,20	EUR	24,20		10.357,60	0,2%
HERMES, FP	27,00	1.295,50	EUR	1.295,50		34.978,50	0,7%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	1.054,00	20,00	EUR	20,00		21.080,00	0,4%
INFINEON, GY	366,00	31,05	EUR	31,05		11.364,30	0,2%
ING Groep, NA	5.100,00	9,53	EUR	9,53		48.582,60	1,0%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
KERING, FP	47,00	579,30	EUR	579,30		27.227,10	0,6%
KONINKLIJKE PHILIPS NV, NA	751,00	27,85	EUR	27,85		20.915,35	0,4%
L' OREAL, FP	152,00	366,20	EUR	366,20		55.662,40	1,1%
LVMH, FP	181,00	651,90	EUR	651,90		117.993,90	2,4%
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	587,00	63,82	EUR	63,82		37.462,34	0,8%
MERCK KGAA, GY	87,00	190,80	EUR	190,80		16.599,60	0,3%
MICHELIN, FP	177,00	123,20	EUR	123,20		21.806,40	0,4%
NOKIA, FH	6.789,00	5,00	EUR	5,00		33.951,79	0,7%
PERNOD-RICARD, FP	173,00	200,60	EUR	200,60		34.703,80	0,7%
RWE, GY	404,00	39,51	EUR	39,51		15.962,04	0,3%
SAFRAN, FP	102,00	107,48	EUR	107,48		10.962,96	0,2%
SAMPO OYJ, FH	610,00	44,59	EUR	44,59		27.199,90	0,6%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	632,00	93,12	EUR	93,12		58.851,84	1,2%
SAP, GY	476,00	101,40	EUR	101,40		48.266,40	1,0%
SCHNEIDER, FP	251,00	152,40	EUR	152,40		38.252,40	0,8%
SHELL PLC, NA	385,00	25,00	EUR	25,00		9.623,08	0,2%
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, SM	415,00	15,96	EUR	15,96		6.623,40	0,1%
SIEMENS, GY	572,00	126,20	EUR	126,20		72.186,40	1,5%
SOCIETE GENERALE, FP	1.545,00	24,37	EUR	24,37		37.651,65	0,8%
ST.GOBAIN, FP	547,00	54,95	EUR	54,95		30.057,65	0,6%
TELEFONICA, SM	5.289,00	4,40	EUR	4,40		23.255,73	0,5%
TELEPERFORMANCE, FP	32,00	346,90	EUR	346,90		11.100,80	0,2%
THALES (Ex -THOMSON), FP,FRF)	156,00	114,50	EUR	114,50		17.862,00	0,4%
TOTALENERGIES SE, FP	1.532,00	46,04	EUR	46,04		70.533,28	1,4%
UNICREDIT, IM	4.458,00	9,89	EUR	9,89		44.102,99	0,9%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	684,00	24,31	EUR	24,31		16.628,04	0,3%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	536,00	29,11	EUR	29,11		15.602,96	0,3%
VINCI, FP	348,00	93,18	EUR	93,18		32.426,64	0,7%
VOLKSWAGEN PFD, GY	140,00	157,48	EUR	157,48		22.047,20	0,4%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	97.216,59	2,0%
1.3.4. Acções					0,00	97.216,59	2,0%
ASHTREAD GROUP, LN, GBP	167,00	48,34	GBP	57,14		9.542,86	0,2%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	99,00	118,50	CHF	115,42		11.426,41	0,2%
GLENCORE XSTRATA, LN, GBP	1.917,00	5,00	GBP	5,91		11.329,32	0,2%
OCADO, LN, GBP	754,00	11,77	GBP	13,91		10.486,22	0,2%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	236,00	58,45	GBP	69,09		16.306,16	0,3%
STELLANTIS NV, IM	2.566,00	14,86	EUR	14,86		38.125,63	0,8%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	950.115,49	19,2%
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	950.115,49	19,2%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	1.273,30	210,34	EUR	210,34		267.826,34	5,4%
CAIXA DISPONIVEL, FIM	20.043,33	5,26	EUR	5,26		105.395,86	2,1%
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM)	2.258,00	43,87	EUR	43,87		99.058,46	2,0%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM)	1.048,00	100,36	EUR	100,36		105.177,28	2,1%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	1.594,08	166,98	EUR	166,98		266.179,31	5,4%
XMSCI JAPAN EUR, FIM	4.199,00	25,36	EUR	25,36		106.478,24	2,2%
4. Imobiliário					0,00	268.023,89	5,4%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário					0,00	268.023,89	5,4%
FUNDIMO (FII)	33.016,00	8,12	EUR	8,12		268.023,89	5,4%
5. Líquidez					0,00	464.376,38	9,4%
5.1. À Vista					0,00	464.376,38	9,4%
Depósitos à Ordem					0,00	464.376,38	9,4%
9. Outros Activos					0,00	5.729,02	0,1%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	5.729,02	0,1%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	0,11	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	859,45	0,0%
Impostos a Regularizar					0,00	12.091,10	0,2%
Comissões					0,00	-7.221,64	-0,1%

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

4.944.609,32
881.193,58
5,61126

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	9,98%
2009	12,13%	10,39%	3 Anos	7,25%
2010	-1,04%	11,06%	5 Anos	2,61%
2011	-7,30%	13,27%	Desde o Início	1,24%
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%		
2019	10,48%	5,98%		
2020	1,55%	16,87%		
2021	9,98%	6,33%		

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