

## LEVE TRI

30 junho 2024

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 na data de referência, 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
<b>Parte I - Valores Patrimoniais</b>					<b>4.618,84</b>	<b>4.275.605,66</b>	<b>100,0%</b>
<b>1. Valores Mobiliários Cotados</b>					<b>4.618,84</b>	<b>4.275.605,66</b>	<b>100,0%</b>
<b>1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal</b>					<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<b>1.1.4. Acções</b>						<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
BANIF, PL	247.226,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
BES, PL (EM LIQUIDACAO)	22.523,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
<b>1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.</b>					<b>4.618,84</b>	<b>4.275.605,66</b>	<b>100,0%</b>
<b>1.2.1. Títulos da Dívida Pública</b>					<b>4.618,84</b>	<b>1.292.637,83</b>	<b>30,2%</b>
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	85.000,00	94,57%	EUR	94,57%	212,38	80.592,63	1,9%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	7.000,00	82,07%	EUR	82,07%	5,27	5.750,31	0,1%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	30.000,00	58,36%	EUR	58,36%	167,69	17.674,79	0,4%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	40.000,00	86,02%	EUR	86,02%	407,72	34.815,32	0,8%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	10.000,00	73,93%	EUR	73,93%	0,00	7.393,00	0,2%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	107.000,00	50,63%	EUR	50,63%	0,00	54.168,75	1,3%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	167.000,00	90,62%	EUR	90,62%	155,14	151.493,88	3,5%
DBR, 0.25%, 15/08/2027, GOVT	25.000,00	93,95%	EUR	93,95%	109,40	23.595,65	0,6%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	200.000,00	83,45%	EUR	83,45%	0,00	166.894,00	3,9%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	83,40%	EUR	83,40%	0,00	30.023,28	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	264.000,00	93,55%	EUR	93,55%	393,11	247.351,91	5,8%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	13.000,00	48,84%	EUR	48,84%	9,62	6.358,43	0,1%
FRTR, 0.25%, 25/05/2034, GOVT	160.000,00	83,24%	EUR	83,24%	197,26	133.382,86	3,1%
IRISH, 1% 15/05/2026, GOVT	45.000,00	96,49%	EUR	96,49%	56,71	43.477,66	1,0%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	28.000,00	91,28%	EUR	91,28%	107,70	25.666,94	0,6%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	10.000,00	46,50%	EUR	46,50%	0,00	4.650,30	0,1%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	73.000,00	110,84%	EUR	110,84%	1.249,08	82.164,47	1,9%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	7.000,00	92,66%	EUR	92,66%	50,35	6.536,76	0,2%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	20.000,00	96,29%	EUR	96,29%	0,00	19.258,20	0,5%
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	20.000,00	70,64%	EUR	70,64%	34,70	14.162,70	0,3%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	60.000,00	55,95%	EUR	55,95%	125,75	33.698,15	0,8%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	46.000,00	82,92%	EUR	82,92%	152,70	38.294,06	0,9%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	12.000,00	64,12%	EUR	64,12%	110,16	7.804,68	0,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	60.000,00	93,93%	EUR	93,93%	1.074,10	57.429,10	1,3%
<b>1.2.4. Acções</b>						<b>2.982.967,83</b>	<b>69,8%</b>
ADIDAS, GY	123,00	222,90	EUR	222,90		27.416,70	0,6%
ADYEN NV, NA	15,00	1.113,20	EUR	1.113,20		16.698,00	0,4%
AHOLD DELHAIZE, NA	415,00	27,59	EUR	27,59		11.449,85	0,3%
AIR LIQUIDE, FP	293,00	161,26	EUR	161,26		47.249,18	1,1%
AIRBUS GROUP, FP	351,00	128,26	EUR	128,26		45.019,26	1,1%
AMADEUS.SA, SM	326,00	61,98	EUR	61,98		20.205,48	0,5%
AMUNDI, FP	237,00	60,25	EUR	60,25		14.279,25	0,3%
ASML HOLDING, NA	202,00	964,20	EUR	964,20		194.768,40	4,6%
ASR NEDERLAND NV, NA	458,00	44,48	EUR	44,48		20.371,84	0,5%
AXA, FP	1.133,00	30,56	EUR	30,56		34.624,48	0,8%
BANCO SABADELL, SM	7.477,00	1,80	EUR	1,80		13.458,60	0,3%
BANCO SANTANDER, SM	8.723,00	4,33	EUR	4,33		37.774,96	0,9%
BAYER, GY	478,00	26,42	EUR	26,42		12.626,37	0,3%
BMW, GY	151,00	88,36	EUR	88,36		13.342,36	0,3%
BNP PARIBAS, FP	611,00	59,53	EUR	59,53		36.372,83	0,9%
CAIXABANK SA, SM	5.273,00	4,94	EUR	4,94		26.059,17	0,6%
CAP GEMINI, FP	147,00	185,65	EUR	185,65		27.290,55	0,6%
CELLNEX TELECOM, SM	476,00	30,37	EUR	30,37		14.456,12	0,3%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	73,00	140,20	CHF	145,53		10.623,42	0,2%
COMMERZBANK, GY	1.059,00	14,13	EUR	14,13		14.958,38	0,3%
CRH, LN, GBP	266,00	58,94	GBP	69,64		18.523,64	0,4%
DANONE, FP	191,00	57,08	EUR	57,08		10.902,28	0,3%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1.782,00	23,48	EUR	23,48		41.841,36	1,0%
DSM-FIRMENICH AG, NA	160,00	105,55	EUR	105,55		16.888,00	0,4%
ENEL, IM	7.722,00	6,49	EUR	6,49		50.146,67	1,2%
ENI SPA, IM	1.410,00	14,35	EUR	14,35		20.233,50	0,5%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	306,00	44,25	EUR	44,25		13.540,50	0,3%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	117,00	201,20	EUR	201,20		23.540,40	0,6%
ESSITY AB, SS, SEK	391,00	270,90	SEK	23,85		9.324,52	0,2%
FERRARI NV, IM	66,00	380,70	EUR	380,70		25.126,20	0,6%
FERROVIAL SE, SM	327,00	36,18	EUR	36,18		11.830,86	0,3%
FINECOBANK SPA, IM	1.591,00	13,91	EUR	13,91		22.130,81	0,5%
HEIDELBERCEMENT, GY	196,00	96,44	EUR	96,44		18.902,24	0,4%
HERMES, FP	24,00	2.139,00	EUR	2.139,00		51.336,00	1,2%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	659,00	46,35	EUR	46,35		30.544,65	0,7%
INFINEON, GY	234,00	34,36	EUR	34,36		8.040,24	0,2%
ING Groep, NA	2.316,00	15,96	EUR	15,96		36.967,99	0,9%
L' OREAL, FP	99,00	410,05	EUR	410,05		40.594,95	0,9%
LVMH, FP	134,00	713,50	EUR	713,50		95.609,00	2,2%
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	404,00	64,43	EUR	64,43		26.029,72	0,6%
MERCK KGAA, GY	95,00	154,90	EUR	154,90		14.715,50	0,3%
MICHELIN, FP	272,00	36,10	EUR	36,10		9.819,20	0,2%
MUNCHENER RUCK, GY	78,00	466,80	EUR	466,80		36.410,40	0,9%
NESTE OYJ, FH	251,00	16,54	EUR	16,54		4.151,54	0,1%
PERNOD-RICARD, FP	131,00	126,65	EUR	126,65		16.591,15	0,4%
PROSUS NV, NA	521,00	33,26	EUR	33,26		17.328,46	0,4%
PUIG BRANDS SA-B, SM	598,00	26,10	EUR	26,10		15.607,80	0,4%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
RWE, GY	420,00	32,02	EUR	32,02		13.448,40	0,3%
SAFRAN, FP	74,00	197,35	EUR	197,35		14.603,90	0,3%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	498,00	89,94	EUR	89,94		44.790,12	1,0%
SAP, GY	348,00	189,82	EUR	189,82		66.057,36	1,5%
SCHNEIDER, FP	291,00	224,30	EUR	224,30		65.271,30	1,5%
SIEMENS, GY	417,00	174,12	EUR	174,12		72.608,04	1,7%
SOCIETE GENERALE, FP	743,00	21,92	EUR	21,92		16.286,56	0,4%
SPIE SA, FP	282,00	33,76	EUR	33,76		9.520,32	0,2%
ST.GOBAIN, FP	272,00	72,62	EUR	72,62		19.752,64	0,5%
STELLANTIS NV, IM	1.358,00	18,47	EUR	18,47		25.082,26	0,6%
STMICROELECTRONICS, FP	534,00	36,87	EUR	36,87		19.685,91	0,5%
THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	94,00	149,50	EUR	149,50		14.053,00	0,3%
TOTALENERGIES SE, FP	932,00	62,33	EUR	62,33		58.091,57	1,4%
UNICREDIT, IM	1.215,00	34,61	EUR	34,61		42.045,08	1,0%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	649,00	27,78	EUR	27,78		18.029,22	0,4%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	578,00	27,91	EUR	27,91		16.131,98	0,4%
VINCI, FP	297,00	98,38	EUR	98,38		29.218,86	0,7%
VONOVIA SE, GY	649,00	26,54	EUR	26,54		17.224,46	0,4%
<b>1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.</b>					<b>0,00</b>	<b>28.835,90</b>	<b>0,7%</b>
<b>1.3.4. Acções</b>					<b>0,00</b>	<b>28.835,90</b>	<b>0,7%</b>
ASHTEAD GROUP, LN, GBP	137,00	52,82	GBP	62,41		8.549,75	0,2%
OCADO, LN, GBP	950,00	2,89	GBP	3,41		3.241,58	0,1%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	151,00	42,82	GBP	50,59		7.639,38	0,2%
SHELL PLC, NA	280,00	33,59	EUR	33,59		9.405,20	0,2%
<b>3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo</b>					<b>0,00</b>	<b>758.338,83</b>	<b>17,7%</b>
<b>3.1. Fundos Harmonizados</b>					<b>0,00</b>	<b>758.338,83</b>	<b>17,7%</b>
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	2,84	11.368,26	EUR	11.368,26		32.285,86	0,8%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	101,55	210,82	EUR	210,82		21.408,56	0,5%
GROUPAMA MONETAIRE	0,14	224.374,31	EUR	224.374,31		32.309,90	0,8%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	2.338,00	109,45	EUR	109,45		255.894,10	6,0%
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	907,00	50,56	EUR	50,56		45.857,92	1,1%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM), ETF	426,00	115,60	EUR	115,60		49.245,60	1,2%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	128,58	165,67	EUR	165,67		21.301,02	0,5%
X USD TREASURIES EUR, FIM, ETF	3.243,00	92,52	EUR	92,52		300.035,87	7,0%
<b>4. Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>210.227,29</b>	<b>4,9%</b>
<b>4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário</b>					<b>0,00</b>	<b>210.227,29</b>	<b>4,9%</b>
FUNDIMO (FI)	24.590,00	8,55	EUR	8,55		210.227,29	4,9%
<b>5. Líquidez</b>					<b>0,00</b>	<b>86.458,25</b>	<b>2,0%</b>
<b>5.1. À Vista</b>					<b>0,00</b>	<b>86.458,25</b>	<b>2,0%</b>
Depósitos à Ordem					0,00	86.458,25	2,0%
<b>9. Outros Activos</b>					<b>0,00</b>	<b>11.483,80</b>	<b>0,3%</b>
<b>9.1. Outros Devedores E Credores</b>					<b>0,00</b>	<b>11.483,80</b>	<b>0,3%</b>
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	269,01	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	625,84	0,0%
Impostos a Regularizar					0,00	16.774,82	0,4%
Comissões					0,00	-6.185,87	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

4.275.605,66

713.554,94

5,99

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
2008	-21,35%	14,29%
2009	12,13%	10,39%
2010	-1,04%	11,06%
2011	-7,30%	13,27%
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%
2022	-13,17%	11,31%
2023	11,84%	8,60%

	Rend. Anualizada
1 Ano	11,84%
3 Anos	2,22%
5 Anos	3,68%
Desde o Inicio	0,92%

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