

LEVE DUO

30 setembro 2024

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 30 junho 2024, 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					7.277.705,03	395.008.393,80	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					7.277.705,03	394.023.075,25	99,8%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					1.070.539,51	60.349.609,51	15,3%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					759.415,71	50.925.445,71	12,9%
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	99,06%	EUR	99,06%	17.149,33	2.989.009,33	0,8%
PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT	5.000.000,00	108,29%	EUR	108,29%	120.696,70	5.535.246,70	1,4%
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	31.000.000,00	105,16%	EUR	105,16%	592.078,77	33.192.298,77	8,4%
REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	91,79%	EUR	91,79%	29.490,91	9.208.890,91	2,3%
1.1.3. Obrigações Diversas					311.123,80	9.424.163,80	2,4%
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP	9.000.000,00	101,26%	EUR	101,26%	311.123,80	9.424.163,80	2,4%
1.1.4. Acções					0,00	0,00	0,0%
BES, PL (EM LIQUIDACAO)	99.815,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					5.220.194,11	250.181.954,19	63,3%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					4.863.077,99	225.690.857,29	57,1%
BTPS, 0.35%, 17/11/2028, GOVT	2.000.000,00	92,10%	EUR	92,10%	4.434,77	1.846.494,77	0,5%
BTPS, 2.5%, 01/12/2024, GOVT	5.000.000,00	99,87%	EUR	99,87%	41.325,13	5.034.875,13	1,3%
BTPS, 2.65%, 01/12/2027, GOVT	5.000.000,00	100,60%	EUR	100,60%	43.804,64	5.073.954,64	1,3%
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	14.000.000,00	108,02%	EUR	108,02%	53.273,49	15.175.513,49	3,8%
BTPS, 5.25%, 01/11/29, GOVT	4.000.000,00	112,02%	EUR	112,02%	87.309,76	4.568.269,76	1,2%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	14.000.000,00	112,03%	EUR	112,03%	375.869,49	16.060.489,49	4,1%
JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, GOVT	1.590.000,00	94,41%	EUR	94,41%	9.291,56	1.510.362,86	0,4%
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	97,16%	EUR	97,16%	231.475,41	19.664.075,41	5,0%
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	900.000,00	95,66%	EUR	95,66%	5.926,76	866.893,76	0,2%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	3.000.000,00	85,30%	EUR	85,30%	1.257,53	2.560.227,53	0,6%
SPGB, 0.6%, 31/10/2029, GOVT	5.000.000,00	91,34%	EUR	91,34%	27.459,02	4.594.459,02	1,2%
SPGB, 2.75%, 31/10/2024, GOVT	23.900.000,00	99,95%	EUR	99,95%	601.581,28	24.490.587,28	6,2%
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	24.500.000,00	110,74%	EUR	110,74%	1.154.880,46	28.285.445,46	7,2%
SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT	30.000.000,00	121,59%	EUR	121,59%	293.013,70	36.769.413,70	9,3%
SPGB, 5.9%, 30/07/2026, GOVT	2.000.000,00	106,31%	EUR	106,31%	20.043,84	2.146.303,84	0,5%
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	48.000.000,00	114,86%	EUR	114,86%	1.912.131,15	57.043.491,15	14,4%
1.2.3. Obrigações Diversas					357.116,12	24.491.096,90	6,2%
ALD, 4.25%, 18/01/2027, CORP	1.500.000,00	102,71%	EUR	102,71%	44.590,16	1.585.225,16	0,4%
BANCO SANTANDER, 3.25%, 04/04/2026, CORP	4.100.000,00	100,29%	EUR	100,29%	65.347,26	4.177.073,26	1,1%
BANCO SANTANDER, VAR, 18/10/2027, CORP, CALL	2.000.000,00	103,14%	EUR	103,14%	87.950,82	2.150.810,82	0,5%
BBVA, 0.375%, 02/10/2024, CORP	400.000,00	100,00%	EUR	100,00%	1.491,80	401.491,80	0,1%
BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP	2.600.000,00	95,06%	EUR	95,06%	9.234,97	2.480.898,97	0,6%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0%, 25/05/2029, CORP	1.000.000,00	88,86%	EUR	88,86%	0,00	888.600,00	0,2%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0,6%, 25/11/2029, CORP	1.000.000,00	90,42%	EUR	90,42%	5.081,97	909.271,97	0,2%
CAIXABANK, 0.625%, 01/10/2024, CORP	5.000.000,00	100,00%	EUR	100,00%	31.164,62	5.031.164,62	1,3%
CREDIT AGRICOLE, 2.7%, 15/07/2025, CORP	300.000,00	99,39%	EUR	99,39%	1.694,84	299.876,84	0,1%
CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP	175.000,00	99,41%	EUR	99,41%	880,94	174.851,94	0,0%
FORVIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	1.050.000,00	94,40%	EUR	94,40%	7.273,44	998.462,94	0,3%
FRESENIUS, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	500.000,00	102,11%	EUR	102,11%	7.277,40	517.837,40	0,1%
RYANAIR DAC, 0.875%, 25/05/2026, CORP	939.000,00	96,75%	EUR	96,75%	2.881,32	911.382,60	0,2%
SECURITAS TREASURY IRELAND, 4.375%, 06/03/2029, CORP, CALL	3.700.000,00	104,65%	EUR	104,65%	92.246,58	3.964.148,58	1,0%

1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					986.971,41	83.491.511,55	21,1%
1.3.3.	Obrigações Diversas					986.971,41	83.491.511,55	21,1%
	ACCOR, 2.375%, 29/11/2028, CORP, CALL	3.500.000,00	96,82%	EUR	96,82%	69.497,94	3.458.162,94	0,9%
	AMERICAN AIRLINES, 4.95%, 15/02/2025 (EXT DT 2026) CORP, SINK, USD	669.000,00	99,32%	USD	88,71%	3.697,25	597.192,75	0,2%
	ASHTREAD, 4%, 01/05/2028, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	97,53%	USD	87,11%	29.574,05	1.771.749,83	0,4%
	ASOS, 0.75%, 16/04/2026, CORP, GBP, CALL, CONV	1.500.000,00	86,21%	GBP	103,19%	6.144,38	1.554.029,90	0,4%
	AXA WRLD EUR INF PLS-IEURACC (FIM)	386,36	111,22%	EUR		0,00	42.970,59	0,0%
	BARCLAYS, 3%, 08/05/2026, CORP, GBP	2.000.000,00	97,14%	GBP	116,28%	28.530,96	2.354.039,98	0,6%
	BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL	400.000,00	98,36%	EUR	98,36%	4.688,77	398.132,77	0,1%
	BNP PARIBAS, 2.875%, 01/10/2026, CORP	2.000.000,00	99,62%	EUR	99,62%	57.342,90	2.049.822,90	0,5%
	BOEING CO, 4.875%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL	500.000,00	99,66%	USD	89,01%	9.010,84	454.076,04	0,1%
	CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 2.75%, 25/02/2029, CORP	2.000.000,00	100,75%	EUR	100,75%	32.759,56	2.047.659,56	0,5%
	CANARY WHARF, 2.625%, 23/04/2025, CORP, GBP, CALL	4.300.000,00	97,62%	GBP	116,85%	59.064,50	5.083.408,84	1,3%
	CGNPC INTERNATIONAL LTD, 2%, 11/09/2025, CORP	2.000.000,00	98,46%	EUR	98,46%	2.082,19	1.971.302,19	0,5%
	DELTA AIR LINES, 4.5%, 20/10/2025, CORP, USD, SINK, 144A	831.608,79	99,65%	USD	89,00%	6.499,26	746.642,97	0,2%
	ENERGY TRANSFER, 4.2%, 15/04/2027, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	99,69%	USD	89,04%	34.387,29	1.815.273,33	0,5%
	ENERGY TRANSFER, 5.5%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL	1.800.000,00	102,57%	USD	91,61%	29.229,19	1.678.280,64	0,4%
	EXPEDIA GROUP, 6.25%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	100,26%	USD	89,55%	34.657,09	1.377.904,68	0,3%
	FREEPORT-MCMORAN, 4.125%, 01/03/2028, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	98,68%	USD	88,14%	2.967,95	884.345,22	0,2%
	INTERNATIONAL GAME TECH, 3.5%, 15/06/2026, CORP, CALL	1.100.000,00	99,62%	EUR	99,62%	11.229,16	1.107.082,16	0,3%
	IQVIA, 5%, 15/10/2026, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	99,75%	USD	89,09%	61.405,86	2.734.208,65	0,7%
	LITHIA MOTORS, 4.625%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	97,74%	USD	87,30%	24.097,14	1.770.006,39	0,4%
	MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL	3.000.000,00	100,94%	USD	90,15%	45.914,82	2.750.523,61	0,7%
	MEITUAN, 2.125%, 28/10/2025, CORP, USD, CALL	200.000,00	97,11%	USD	86,74%	1.602,76	175.075,43	0,0%
	MPT OPER, 3.325%, 24/03/2025, CORP, CALL	1.000.000,00	97,19%	EUR	97,19%	17.308,22	989.228,22	0,3%
	NISSAN MOTOR, 2.652%, 17/03/2026, CORP, CALL	1.500.000,00	98,82%	EUR	98,82%	21.470,30	1.503.770,30	0,4%
	OPEN TEXT, 6.9%, 01/12/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	105,53%	USD	94,25%	30.557,79	1.444.370,75	0,4%
	PHILIP MORRIS, 0.625%, 08/11/2024, CORP, CALL	3.700.000,00	99,70%	EUR	99,70%	20.660,86	3.709.523,86	0,9%
	PINGAN REAL ESTATE, 3.25%, 23/06/2025, CORP, USD	30.000.000,00	95,94%	USD	85,69%	234.644,87	25.941.504,46	6,6%
	QORVO, 1.75%, 15/12/2024, CORP, CALL, USD	1.250.000,00	99,20%	USD	88,60%	5.698,65	1.113.225,89	0,3%
	RADIAN GROUP, 4.875%, 15/03/2027, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	100,23%	USD	89,53%	1.814,26	897.071,50	0,2%
	SINOCHEM OFFSHORE, 1.625%, 29/10/2025, CORP, USD	1.000.000,00	96,68%	USD	86,35%	6.087,87	869.610,56	0,2%
	SMITHFIELD FOODS, 4.25%, 01/02/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.000.000,00	98,43%	USD	87,92%	6.221,22	885.392,35	0,2%
	T-MOBILE USA, 2.25%, 15/02/2026, CORP, USD, CALL	1.500.000,00	97,22%	USD	86,84%	3.768,09	1.306.353,83	0,3%
	TOWER BERSAMA, 2.75%, 20/01/2026, CORP, CALL, USD	1.800.000,00	96,99%	USD	86,63%	8.596,82	1.567.953,73	0,4%
	TRITON CONTAINER, 2.05%, 15/04/2026, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	95,76%	USD	85,54%	16.784,26	1.727.484,50	0,4%
	UNITED RENTALS, 4.875%, 15/01/2028, CORP, USD, CALL	2.500.000,00	99,35%	USD	88,74%	22.678,31	2.241.171,53	0,6%
	UTAH ACQUISITION SUB, 2.25%, 22/11/2024, CORP, CALL	1.000.000,00	99,80%	EUR	99,80%	19.241,80	1.017.201,80	0,3%
	VISTRA OPERATIONS, 5.125%, 13/05/2025, CORP, USD, 144A	650.000,00	99,63%	USD	88,99%	11.323,02	589.745,23	0,1%
	ZHONGSHENG, 3%, 13/01/2026, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	96,32%	USD	86,03%	5.731,21	866.011,67	0,2%
5.	Liquidez					0,00	1.006.722,37	0,3%
5.1.	À Vista					0,00	1.006.722,37	0,3%
	Depósitos à Ordem					0,00	1.006.722,37	0,3%
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 DEZ24	66,00	0,00	GBP	0,00	0,00	0,00	0,0%
	EURUSD FX CURR FUT DEZ24	405,00	0,00	USD	0,00	0,00	0,00	0,0%
	EURUSD FX CURR FUT MAR25	55,00	0,00	USD	0,00	0,00	0,00	0,0%
9.	Outros Activos					0,00	-21.403,82	0,0%
9.1.	Outros Devedores E Credores					0,00	-21.403,82	0,0%
	Juros de D.O. a Regularizar					0,00	-21.071,61	0,0%
	Transacções a Liquidar					0,00	-332,21	0,0%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

395.008.393,80

0,00

0,00

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.