

LEVE TRI

31 maio 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
Parte I - Valores Patrimoniais					3.703,97	4.325.006,94	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					3.703,97	4.325.006,94	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 (EM LIQUIDACAO)	22.523,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					3.703,97	4.325.006,94	100,0%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					3.703,97	1.285.176,98	29,7%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	85.000,00	93,74%	EUR	93,74%	44,71	79.722,01	1,8%
BKO, 0.2%, 24/06/2024, GOVT	60.000,00	99,91%	EUR	99,91%	115,41	60.059,01	1,4%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	7.000,00	82,40%	EUR	82,40%	33,07	5.800,79	0,1%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	30.000,00	59,55%	EUR	59,55%	126,11	17.990,81	0,4%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	40.000,00	87,34%	EUR	87,34%	306,63	35.241,83	0,8%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	10.000,00	72,48%	EUR	72,48%	0,00	7.248,20	0,2%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	107.000,00	48,99%	EUR	48,99%	0,00	52.417,16	1,2%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	167.000,00	89,54%	EUR	89,54%	120,92	149.651,05	3,5%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	25.000,00	93,11%	EUR	93,11%	99,15	23.377,40	0,5%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	200.000,00	82,10%	EUR	82,10%	0,00	164.192,00	3,8%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	83,02%	EUR	83,02%	0,00	29.886,84	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	264.000,00	93,30%	EUR	93,30%	339,02	246.637,82	5,7%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	13.000,00	50,43%	EUR	50,43%	1,60	6.557,11	0,2%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	90.000,00	84,06%	EUR	84,06%	18,49	75.674,29	1,7%
IRISH, 1% 15/05/2026, GOVT	45.000,00	96,10%	EUR	96,10%	19,73	43.266,08	1,0%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	28.000,00	90,66%	EUR	90,66%	76,64	25.460,88	0,6%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	10.000,00	45,65%	EUR	45,65%	0,00	4.565,20	0,1%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	73.000,00	109,73%	EUR	109,73%	1.024,69	81.123,94	1,9%
NETHERLANDS, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	7.000,00	91,88%	EUR	91,88%	46,05	6.477,37	0,1%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	20.000,00	95,83%	EUR	95,83%	0,00	19.165,20	0,4%
RAGB, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	20.000,00	70,01%	EUR	70,01%	30,60	14.032,80	0,3%
RAGB, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	60.000,00	55,71%	EUR	55,71%	88,77	33.515,97	0,8%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	46.000,00	82,60%	EUR	82,60%	133,85	38.128,93	0,9%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	12.000,00	64,20%	EUR	64,20%	100,33	7.804,69	0,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	60.000,00	93,67%	EUR	93,67%	978,20	57.179,60	1,3%
1.2.4. Acções						3.039.829,96	70,3%
ADIDAS, GY	126,00	230,40	EUR	230,40		29.030,40	0,7%
ADYEN NV, NA	15,00	1.184,60	EUR	1.184,60		17.769,00	0,4%
AHOLD DELHAIZE, NA	423,00	28,54	EUR	28,54		12.072,42	0,3%
AIR LIQUIDE, FP	271,00	180,44	EUR	180,44		48.899,24	1,1%
AIRBUS GROUP, FP	358,00	155,88	EUR	155,88		55.805,04	1,3%
AMADEUS, SA, SM	333,00	65,00	EUR	65,00		21.645,00	0,5%
AMUNDI, FP	242,00	70,65	EUR	70,65		17.097,30	0,4%
ASML HOLDING, NA	206,00	870,80	EUR	870,80		179.384,80	4,1%
ASR NEDERLAND NV, NA	467,00	44,40	EUR	44,40		20.734,80	0,5%
AXA, FP	1.156,00	33,05	EUR	33,05		38.205,80	0,9%
BANCO SABADELL, SM	7.628,00	1,94	EUR	1,94		14.794,51	0,3%
BANCO SANTANDER, SM	8.900,00	4,82	EUR	4,82		42.898,01	1,0%
BAYER, GY	488,00	28,25	EUR	28,25		13.783,56	0,3%
BMW, GY	154,00	92,88	EUR	92,88		14.303,52	0,3%
BNP PARIBAS, FP	623,00	67,69	EUR	67,69		42.170,87	1,0%
CAIXABANK SA, SM	5.380,00	5,25	EUR	5,25		28.245,00	0,7%
CAP GEMINI, FP	150,00	185,55	EUR	185,55		27.832,50	0,6%
CELLNEX TELECOM, SM	486,00	33,53	EUR	33,53		16.295,58	0,4%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	74,00	144,00	CHF	146,67		10.853,53	0,3%
COMMERZBANK, GY	1.080,00	15,50	EUR	15,50		16.740,00	0,4%
CRH, LN, GBP	271,00	61,18	GBP	71,67		19.422,22	0,4%
DANONE, FP	195,00	59,10	EUR	59,10		11.524,50	0,3%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1.818,00	22,34	EUR	22,34		40.614,12	0,9%
DHL GROUP, GY	299,00	38,61	EUR	38,61		11.544,39	0,3%
DSM-FIRMENICH AG, NA	163,00	105,55	EUR	105,55		17.204,65	0,4%
ENEL, IM	7.878,00	6,65	EUR	6,65		52.420,21	1,2%
ENI SPA, IM	1.439,00	14,50	EUR	14,50		20.859,74	0,5%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	312,00	44,96	EUR	44,96		14.027,52	0,3%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	119,00	205,10	EUR	205,10		24.406,90	0,6%
ESSITY AB, SS, SEK	399,00	269,40	SEK	23,59		9.411,66	0,2%
FERRARI NV, IM	67,00	377,30	EUR	377,30		25.279,10	0,6%
FERROVIAL SE, SM	334,00	36,26	EUR	36,26		12.110,84	0,3%
FINECOBANK SPA, IM	1.623,00	14,81	EUR	14,81		24.036,63	0,6%
HEIDELBERCEMENT, GY	200,00	95,70	EUR	95,70		19.140,00	0,4%
HERMES, FP	24,00	2.175,00	EUR	2.175,00		52.200,00	1,2%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	672,00	43,52	EUR	43,52		29.245,44	0,7%
INFINEON, GY	239,00	36,78	EUR	36,78		8.790,42	0,2%
ING Groep, NA	2.363,00	16,36	EUR	16,36		38.663,41	0,9%
L' OREAL, FP	101,00	451,95	EUR	451,95		45.646,95	1,1%
LVMH, FP	137,00	734,80	EUR	734,80		100.667,60	2,3%
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	412,00	66,28	EUR	66,28		27.307,36	0,6%
MERCK KGAA, GY	97,00	166,85	EUR	166,85		16.184,45	0,4%
MICHELIN, FP	277,00	37,11	EUR	37,11		10.279,47	0,2%
MUNCHENER RUCK, GY	80,00	459,10	EUR	459,10		36.728,00	0,8%
NESTE OYJ, FH	256,00	19,25	EUR	19,25		4.928,00	0,1%
PERNOD-RICARD, FP	134,00	136,90	EUR	136,90		18.344,60	0,4%
PROSUS NV, NA	532,00	33,38	EUR	33,38		17.755,50	0,4%
PUIG BRANDS SA-B, SM	610,00	25,96	EUR	25,96		15.835,60	0,4%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
RWE, GY	428,00	34,86	EUR	34,86		14.920,08	0,3%
SAFRAN, FP	76,00	214,10	EUR	214,10		16.271,60	0,4%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	508,00	89,74	EUR	89,74		45.587,92	1,1%
SAP, GY	355,00	166,10	EUR	166,10		58.965,50	1,4%
SCHNEIDER, FP	297,00	227,45	EUR	227,45		67.552,65	1,6%
SIEMENS, GY	425,00	175,94	EUR	175,94		74.774,50	1,7%
SOCIETE GENERALE, FP	758,00	27,39	EUR	27,39		20.757,83	0,5%
ST.GOBAIN, FP	277,00	80,56	EUR	80,56		22.315,12	0,5%
STELLANTIS NV, IM	1.386,00	20,20	EUR	20,20		27.997,20	0,6%
STMICROELECTRONICS, FP	545,00	37,85	EUR	37,85		20.628,25	0,5%
THALES (Ex -THOMSON) ,FP,FRF)	96,00	166,60	EUR	166,60		15.993,60	0,4%
TOTALENERGIES SE, FP	951,00	67,00	EUR	67,00		63.717,01	1,5%
UNICREDIT, IM	1.240,00	36,38	EUR	36,38		45.111,20	1,0%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	662,00	28,55	EUR	28,55		18.900,10	0,4%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	590,00	30,70	EUR	30,70		18.113,00	0,4%
VINCI, FP	288,00	114,40	EUR	114,40		32.947,20	0,8%
VONOVIA SE, GY	662,00	28,42	EUR	28,42		18.814,04	0,4%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	31.084,24	0,7%
1.3.4. Acções					0,00	31.084,24	0,7%
ASHTREAD GROUP, LN, GBP	140,00	56,80	GBP	66,54		9.315,29	0,2%
OCADO, LN, GBP	969,00	3,74	GBP	4,38		4.240,84	0,1%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	154,00	44,52	GBP	52,15		8.031,49	0,2%
SHELL PLC, NA	286,00	33,21	EUR	33,21		9.496,63	0,2%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	701.171,58	16,2%
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	701.171,58	16,2%
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	6,90	11.335,32	EUR	11.335,32		78.202,37	1,8%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	101,55	209,47	EUR	209,47		21.271,47	0,5%
GROUPAMA MONETAIRE	0,33	223.692,21	EUR	223.692,21		73.818,43	1,7%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	2.391,00	109,12	EUR	109,12		260.905,92	6,0%
ISHARES EUROSTOXX UCITS ETF DE (FIM), ETF	907,00	52,53	EUR	52,53		47.644,71	1,1%
ISHARES S&P 500 EUR HEDGED (FIM), ETF	426,00	109,47	EUR	109,47		46.634,22	1,1%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	128,58	164,51	EUR	164,51		21.151,87	0,5%
XUSD TREASURIES EUR, FIM, ETF	1.657,00	91,46	EUR	91,46		151.542,59	3,5%
4. Imobiliário					0,00	211.764,16	4,9%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário					0,00	211.764,16	4,9%
FUNDIMO (FII)	24.590,00	8,61	EUR	8,61		211.764,16	4,9%
5. Liquidez					0,00	105.676,07	2,4%
5.1. À Vista					0,00	105.676,07	2,4%
Depósitos à Ordem					0,00	105.676,07	2,4%
9. Outros Activos					0,00	13.626,95	0,3%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	13.626,95	0,3%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	299,67	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	2.974,62	0,1%
Impostos a Regularizar					0,00	16.842,59	0,4%
Comissões					0,00	-6.489,93	-0,2%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

4.325.006,94

714.307,99

6,05

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.