

IB LEVE II

30 junho 2024

O produto LEVE II teve o início da comercialização em 13/03/2008. De acordo com o estipulado no Prospecto Informativo, elaborámos um relatório com referência a 30 junho de 2023, 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					31.563,58	4.689.876,01	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					31.067,32	4.424.071,97	94,3%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					25.697,12	3.411.439,77	72,7%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					9.538,04	997.747,04	21,3%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	900.000,00	109,80%	EUR	109,80%	9.538,04	997.747,04	21,3%
1.2.3. Obrigações Diversas					16.159,08	2.413.692,73	51,5%
EU, 0.8%, 04/07/2025, CORP	1.859.000,00	97,54%	EUR	97,54%	14.709,46	1.827.885,11	39,0%
FORVIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	300.000,00	93,81%	EUR	93,81%	296,88	281.714,88	6,0%
FRESENIUS SE & CO KGAA, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	300.000,00	100,98%	EUR	100,98%	1.152,74	304.092,74	6,5%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					5.370,20	1.012.632,20	21,6%
1.3.3. Obrigações Diversas					5.370,20	1.012.632,20	21,6%
ALIMENTATION COUCHE-TARD, 1.875%, 06/05/2026, CORP, CALL	150.000,00	96,80%	EUR	96,80%	423,80	145.617,80	3,1%
BERRY GLOBAL, 1.5%, 15/01/2027, CORP, CALL	300.000,00	93,50%	EUR	93,50%	2.062,50	282.562,50	6,0%
CRCC HEAN, 0.875%, 20/05/2026, 20/05/2026, CORP, CALL	300.000,00	94,12%	EUR	94,12%	294,86	282.645,86	6,0%
LLOYDS BANKING, 3.5%, 01/04/2026, CORP, CALL	300.000,00	99,74%	EUR	99,74%	2.589,04	301.806,04	6,4%
2. Valores Não Cotados					496,26	268.072,16	5,7%
2.2. Valores Mobiliários Estrangeiros					496,26	268.072,16	5,7%
2.2.3. Obrigações Diversas					496,26	268.072,16	5,7%
CENTENE CORP, 4.25%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL	300.000,00	95,48%	USD	89,19%	496,26	268.072,16	5,7%
5. Liquidez					0,00	-2.379,04	-0,1%
5.1. À Vista						-2.379,04	-0,1%
Depósitos à Ordem						-2.379,04	-0,1%
7. Operações Com Produtos Derivados						0,00	0,0%
7.1. Em Mercado Regulamentado						0,00	0,0%
7.1.1. Futuros						0,00	0,0%
EURUSD FX CURR FUT SET24	2,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9. Outros Activos						110,92	0,0%
9.1. Outros Devedores E Credores						110,92	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar						110,92	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:

- 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%;
- 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.