

LEVE DUO

30 junho 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					6.289.282,51	401.239.172,53	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					6.129.149,67	381.649.859,75	95,1%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					523.764,50	58.458.824,50	14,6%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					348.296,57	49.430.236,57	12,3%
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	96,09%	EUR	96,09%	2.404,11	2.885.074,11	0,7%
PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT	5.000.000,00	105,25%	EUR	105,25%	71.994,52	5.334.494,52	1,3%
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	31.000.000,00	103,41%	EUR	103,41%	269.763,70	32.325.933,70	8,1%
REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	88,81%	EUR	88,81%	4.134,24	8.884.734,24	2,2%
1.1.3. Obrigações Diversas					175.467,93	9.028.587,93	2,3%
CGD, 5.98%, 03/03/2028, CORP	9.000.000,00	98,37%	EUR	98,37%	175.467,93	9.028.587,93	2,3%
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.					5.121.224,98	253.773.184,65	63,2%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					4.794.022,94	222.502.324,14	55,5%
BTPS, 0.35%, 17/11/2028, GOVT	2.000.000,00	88,28%	EUR	88,28%	1.434,78	1.766.974,78	0,4%
BTPS, 2.5%, 01/12/2024, GOVT	5.000.000,00	99,53%	EUR	99,53%	9.904,37	4.986.154,37	1,2%
BTPS, 2.65%, 01/12/2027, GOVT	5.000.000,00	97,66%	EUR	97,66%	10.498,63	4.893.548,63	1,2%
BTPS, 3.75%, 01/09/2024, GOVT	1.500.000,00	100,01%	EUR	100,01%	18.495,25	1.518.660,25	0,4%
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	14.000.000,00	104,97%	EUR	104,97%	218.654,91	14.914.874,91	3,7%
BTPS, 5.25%, 01/11/29, GOVT	4.000.000,00	108,34%	EUR	108,34%	34.809,77	4.368.569,77	1,1%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	14.000.000,00	109,80%	EUR	109,80%	148.369,54	15.520.509,54	3,9%
JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, GOVT	1.590.000,00	91,41%	EUR	91,41%	3.704,48	1.457.091,68	0,4%
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	95,12%	EUR	95,12%	171.147,54	19.195.947,54	4,8%
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	900.000,00	92,70%	EUR	92,70%	2.362,96	836.689,96	0,2%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	3.000.000,00	81,73%	EUR	81,73%	501,37	2.452.431,37	0,6%
SPGB, 0.6%, 31/10/2029, GOVT	5.000.000,00	88,14%	EUR	88,14%	19.918,03	4.426.868,03	1,1%
SPGB, 2.75%, 31/10/2024, GOVT	23.900.000,00	99,74%	EUR	99,74%	436.370,90	24.274.947,90	6,0%
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	24.500.000,00	108,55%	EUR	108,55%	837.719,26	27.432.224,26	6,8%
SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT	30.000.000,00	117,97%	EUR	117,97%	1.583.606,56	36.973.706,56	9,2%
SPGB, 5.9%, 30/07/2026, GOVT	2.000.000,00	105,49%	EUR	105,49%	108.327,87	2.218.127,87	0,6%
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	48.000.000,00	112,66%	EUR	112,66%	1.188.196,72	55.264.996,72	13,8%
1.2.3. Obrigações Diversas					327.202,04	31.270.860,51	7,8%
ACCOR, 2.375%, 29/11/2028, CORP, CALL	3.500.000,00	94,01%	EUR	94,01%	48.603,13	3.338.813,13	0,8%
ALD SA, 4.25%, 18/01/2027, CORP	1.500.000,00	101,27%	EUR	101,27%	28.565,57	1.547.660,57	0,4%
BANCO SANTANDER, 3.25%, 04/04/2026, CORP	4.100.000,00	98,94%	EUR	98,94%	31.760,96	4.088.300,96	1,0%
BANCO SANTANDER, VAR, 18/10/2027, CORP, CALL	2.000.000,00	101,80%	EUR	101,80%	64.699,45	2.100.659,45	0,5%
BBVA, 0.375%, 02/10/2024, CORP	400.000,00	99,15%	EUR	99,15%	1.114,75	397.698,75	0,1%
BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP	2.600.000,00	92,53%	EUR	92,53%	5.967,21	2.411.799,21	0,6%
BNP PARIBAS, 2.875%, 01/10/2026, CORP	2.000.000,00	97,94%	EUR	97,94%	42.889,34	2.001.669,34	0,5%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0%, 25/05/2029, CORP	1.000.000,00	85,85%	EUR	85,85%	0,00	858.490,00	0,2%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0,6%, 25/11/2029, CORP	1.000.000,00	87,43%	EUR	87,43%	3.573,77	877.893,77	0,2%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 2.75%, 25/02/2029, CORP	2.000.000,00	98,16%	EUR	98,16%	18.934,43	1.982.114,43	0,5%
CAIXABANK, 0.625%, 01/10/2024, CORP	5.000.000,00	99,21%	EUR	99,21%	23.309,43	4.984.009,43	1,2%
CREDIT AGRICOLE, 2.7%, 15/07/2025, CORP	300.000,00	98,58%	EUR	98,58%	1.691,21	297.428,21	0,1%
CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP	175.000,00	98,03%	EUR	98,03%	876,92	172.425,92	0,0%
FORVIA, 2.375%, 15/06/2027, CORP, CALL	1.050.000,00	93,81%	EUR	93,81%	1.039,06	986.002,06	0,2%
FRESENIUS SE & CO KGAA, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	500.000,00	100,98%	EUR	100,98%	1.921,23	506.821,23	0,1%
RYANAIR DAC, 0.875%, 25/05/2026, CORP	939.000,00	94,87%	EUR	94,87%	810,37	891.667,84	0,2%
SECURITAS TREASURY IRELAND, 4.375%, 06/03/2029, CORP, CALL	3.700.000,00	102,05%	EUR	102,05%	51.445,21	3.827.406,21	1,0%

Designação		Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
1.3.	Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					484.160,19	69.417.850,60	17,3%
1.3.3.	Obrigações Diversas					484.160,19	69.417.850,60	17,3%
	ASHTAD, 4%, 01/05/2028, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	94,58%	USD	88,35%	12.247,65	1.779.197,68	0,4%
	BARCLAYS, 3%, 08/05/2026, CORP, GBP	2.000.000,00	95,90%	GBP	113,31%	10.293,64	2.276.415,24	0,6%
	BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL	400.000,00	95,95%	EUR	95,95%	2.521,10	386.337,10	0,1%
	BOEING CO, 4.875%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL	500.000,00	98,94%	USD	92,43%	3.731,71	465.866,22	0,1%
	CANARY WHARF, 2.625%, 23/04/2025, CORP, GBP, CALL	4.300.000,00	94,29%	GBP	111,41%	24.777,65	4.815.397,70	1,2%
	CGNPC INTERNATIONAL LTD, 2%, 11/09/2025, CORP	2.000.000,00	97,33%	EUR	97,33%	32.021,86	1.978.681,86	0,5%
	CORNWALL JERSEY, 0.75%, 16/04/2026, CORP, GBP, CALL, CONV	1.500.000,00	68,99%	GBP	81,51%	2.723,75	1.225.419,23	0,3%
	DS SMITH, 4.375%, 27/07/2027, CORP, CALL	1.000.000,00	101,96%	EUR	101,96%	40.522,54	1.060.152,54	0,3%
	EBAY, 3.45%, 01/08/2024, CORP, USD, CALL	5.000.000,00	99,78%	USD	93,21%	66.693,91	4.727.273,08	1,2%
	ENERGY TRANSFER, 4.2%, 15/04/2027, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	97,00%	USD	90,61%	16.347,51	1.828.491,37	0,5%
	EXPEDIA GROUP, 6.25%, 01/05/2025, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	100,26%	USD	93,65%	14.352,72	1.419.168,22	0,4%
	FREEPORT-MCMORAN INC, 4.125%, 01/03/2028, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	95,97%	USD	89,65%	12.737,43	909.206,37	0,2%
	FUQING INV, 3.25%, 23/06/2025, CORP, USD	30.000.000,00	92,52%	USD	86,42%	17.709,80	25.944.659,83	6,5%
	HESS, 3.5%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL	1.600.000,00	99,84%	USD	93,27%	23.976,33	1.516.228,55	0,4%
	INTERNATIONAL GAME TECH, 3.5%, 15/06/2026, CORP, CALL	1.100.000,00	98,65%	EUR	98,65%	1.604,17	1.086.754,17	0,3%
	MEITUAN, 2.125%, 28/10/2025, CORP, USD, CALL	200.000,00	95,50%	USD	89,21%	683,74	179.110,64	0,0%
	MPT OPER, 3.325%, 24/03/2025, CORP, CALL	1.000.000,00	94,54%	EUR	94,54%	8.927,40	954.297,40	0,2%
	NISSAN MOTOR, 2.652%, 17/03/2026, CORP, CALL	1.500.000,00	97,84%	EUR	97,84%	11.443,56	1.479.028,56	0,4%
	PHILIP MORRIS, 0.625%, 08/11/2024, CORP, CALL	3.700.000,00	98,86%	EUR	98,86%	14.848,02	3.672.742,02	0,9%
	RADIAN GROUP, 4.875%, 15/03/2027, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	97,75%	USD	91,32%	13.282,35	926.435,08	0,2%
	SINOCHEM OFFSHORE, 1.625%, 29/10/2025, CORP, USD	1.000.000,00	94,96%	USD	88,71%	2.572,14	889.671,62	0,2%
	T-MOBILE USA, 2.25%, 15/02/2026, CORP, USD, CALL	1.500.000,00	95,05%	USD	88,79%	11.822,75	1.343.649,01	0,3%
	TOWER BERSAMA, 2.75%, 20/01/2026, CORP, CALL, USD	1.800.000,00	95,23%	USD	88,95%	20.551,15	1.621.718,83	0,4%
	UNITED RENTALS, 4.875%, 15/01/2028, CORP, USD, CALL	2.500.000,00	96,85%	USD	90,47%	52.180,65	2.313.880,79	0,6%
	UTAH ACQUISITION SUB, 2.25%, 22/11/2024, CORP, CALL	1.000.000,00	99,31%	EUR	99,31%	13.586,06	1.006.646,06	0,3%
	ZHONGSHENG, 3%, 13/01/2026, CORP, USD, CALL	4.000.000,00	95,26%	USD	88,99%	52.000,60	3.611.421,43	0,9%
2.	Valores Não Cotados					160.132,84	19.452.487,63	4,8%
2.2.	Valores Mobiliários Estrangeiros					160.132,84	19.452.487,63	4,8%
2.2.3.	Obrigações Diversas					160.132,84	19.452.487,63	4,8%
	AMERICAN AIRLINES, 4.95%, 15/02/2025 (EXT DT 2026) CORP, SINK, USD	759.500,00	98,74%	USD	92,24%	13.169,75	713.718,93	0,2%
	DELTA AIR LINES, 4.5%, 20/10/2025, CORP, USD, SINK, 144A	998.116,89	98,83%	USD	92,32%	8.158,36	929.642,62	0,2%
	ENERGY TRANSFER OPER, 5.5%, 01/06/2027, CORP, USD, CALL	1.800.000,00	100,32%	USD	93,71%	7.449,79	1.694.203,65	0,4%
	IQVIA, 5%, 15/10/2026, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	98,20%	USD	91,74%	29.191,97	2.781.317,14	0,7%
	LITHIA MOTORS, 4.625%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	95,52%	USD	89,23%	3.600,34	1.788.186,98	0,4%
	MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL	3.000.000,00	100,34%	USD	93,73%	6.860,11	2.818.733,07	0,7%
	NEXTRA ENERGY OP, 4.25%, 15/07/2024, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	99,87%	USD	93,30%	54.589,00	2.853.486,71	0,7%
	OPEN TEXT, 6.9%, 01/12/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	103,20%	USD	96,40%	7.788,42	1.453.785,62	0,4%
	QORVO, 1.75%, 15/12/2024, CORP, CALL, USD	1.250.000,00	98,04%	USD	91,58%	851,43	1.145.620,23	0,3%
	SMITHFIELD FOODS, 4.25%, 01/02/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.000.000,00	96,26%	USD	89,92%	16.431,83	915.675,18	0,2%
	TRITON CONTAINER, 2.05%, 15/04/2026, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	93,28%	USD	87,14%	7.979,13	1.750.772,22	0,4%
	VISTRA OPERATIONS, 5.125%, 13/05/2025, CORP, USD, 144A	650.000,00	99,36%	USD	92,81%	4.062,71	607.345,28	0,2%
3.	Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	42.290,60	0,0%
3.1.	Fundos Harmonizados					0,00	42.290,60	0,0%
	AXA WRLD EUR INF PLS-IEURACC (FIM)	386,36	109,46	EUR	109,46		42.290,60	0,0%
5.	Liquidez					0,00	113.413,35	0,0%
5.1.	À Vista					0,00	113.413,35	0,0%
	Depósitos à Ordem					0,00	113.413,35	0,0%
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 SET24	65,00	0,00	GBP	0,00		0,00	0,0%
	EURUSD FX CURR FUT SET24	534,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9.	Outros Activos					0,00	-18.878,80	0,0%
9.1.	Outros Devedores E Credores					0,00	-18.878,80	0,0%
	Juros de D.O. a Regularizar					0,00	-18.878,80	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:

- 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.