

LEVE TRI

31 julho 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					4.360,51	4.270.397,20	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					4.360,51	4.270.397,20	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.					4.360,51	4.270.397,20	100,0%
1.2.1. Títulos da Dívida Pública					4.360,51	1.320.155,67	30,9%
AUSTRIA, 0.25%, 20/10/2036 GOVT	20.000,00	72,76%	EUR	72,76%	38,93	14.591,13	0,3%
AUSTRIA, 0.75%, 20/03/2051, GOVT	60.000,00	58,85%	EUR	58,85%	163,97	35.472,17	0,8%
AUSTRIA, 2.4%, 23/05/2034, GOVT	85.000,00	96,59%	EUR	96,59%	385,64	82.489,69	1,9%
BTPS, 0.95%, 01/12/2031, GOVT	7.000,00	84,76%	EUR	84,76%	10,90	5.943,75	0,1%
BTPS, 1.7%, 01/09/2051, GOVT	30.000,00	62,21%	EUR	62,21%	210,65	18.873,65	0,4%
BTPS, 3.1%, 01/03/2040, GOVT	40.000,00	90,05%	EUR	90,05%	512,17	36.530,57	0,9%
DBR, 0%, 15/05/2036, GOVT	10.000,00	75,74%	EUR	75,74%	0,00	7.574,30	0,2%
DBR, 0%, 15/08/2050, GOVT	107.000,00	52,87%	EUR	52,87%	0,00	56.566,62	1,3%
DBR, 0.25%, 15/02/2029, GOVT	167.000,00	91,79%	EUR	91,79%	190,50	153.478,13	3,6%
DBR, 0.5%, 15/08/2027, GOVT	25.000,00	94,82%	EUR	94,82%	120,00	23.826,00	0,6%
DBR, CZ, 15/02/2032, GOVT	200.000,00	85,02%	EUR	85,02%	0,00	170.044,00	4,0%
EU, 0%, 04/10/2030, GOVT	36.000,00	85,08%	EUR	85,08%	0,00	30.627,00	0,7%
FRTR, 0.25%, 25/11/2026, GOVT	264.000,00	94,54%	EUR	94,54%	449,02	250.024,06	5,9%
FRTR, 0.75%, 25/05/2053, GOVT	13.000,00	51,56%	EUR	51,56%	17,90	6.720,57	0,2%
FRTR, 1.25%, 25/05/2034, GOVT	160.000,00	85,60%	EUR	85,60%	367,12	137.320,72	3,2%
IRISH, 1% 15/05/2026, GOVT	45.000,00	97,09%	EUR	97,09%	94,93	43.783,18	1,0%
IRISH, 1.35%, 18/03/2031, GOVT	28.000,00	92,94%	EUR	92,94%	139,81	26.163,85	0,6%
NETHER, 0%, 15/07/2052, GOVT	10.000,00	49,10%	EUR	49,10%	0,00	4.910,20	0,1%
NETHER, 0.75%, 15/07/2028, GOVT	7.000,00	93,81%	EUR	93,81%	2,30	6.569,21	0,2%
NETHER, 3.75%, 15/01/2042, GOVT	73.000,00	113,86%	EUR	113,86%	1.480,94	84.597,28	2,0%
OBL, 0%, 10/10/2025, GOVT	20.000,00	96,76%	EUR	96,76%	0,00	19.352,60	0,5%
SPGB, 0.5%, 31/10/2031, GOVT	46.000,00	84,91%	EUR	84,91%	172,19	39.230,33	0,9%
SPGB, 1%, 30/07/2042, GOVT	12.000,00	67,08%	EUR	67,08%	0,33	8.049,45	0,2%
SPGB, 1.95%, 30/07/2030, GOVT	60.000,00	95,69%	EUR	95,69%	3,21	57.417,21	1,3%
1.2.4. Acções						2.950.241,53	69,1%
ADIDAS, GY	123,00	229,30	EUR	229,30		28.203,90	0,7%
ADYEN NV, NA	15,00	1.130,60	EUR	1.130,60		16.959,00	0,4%
AHOLD DELHAIZE, NA	415,00	29,78	EUR	29,78		12.358,70	0,3%
AIR LIQUIDE, FP	293,00	168,76	EUR	168,76		49.446,68	1,2%
AIRBUS GROUP, FP	351,00	139,94	EUR	139,94		49.118,94	1,2%
AMADEUS, SA, SM	326,00	60,74	EUR	60,74		19.801,24	0,5%
AMUNDI, FP	237,00	67,55	EUR	67,55		16.009,35	0,4%
ASML HOLDING, NA	202,00	850,40	EUR	850,40		171.780,80	4,0%
ASR NEDERLAND NV, NA	458,00	46,37	EUR	46,37		21.237,46	0,5%
AXA, FP	1.133,00	32,48	EUR	32,48		36.799,84	0,9%
BANCO SABADELL, SM	7.477,00	1,95	EUR	1,95		14.591,37	0,3%
BANCO SANTANDER, SM	8.723,00	4,45	EUR	4,45		38.856,61	0,9%
BAYER, GY	478,00	27,49	EUR	27,49		13.137,83	0,3%
BMW, GY	151,00	85,72	EUR	85,72		12.943,72	0,3%
BNP PARIBAS, FP	611,00	63,45	EUR	63,45		38.767,95	0,9%
CAIXABANK SA, SM	5.273,00	5,39	EUR	5,39		28.400,38	0,7%
CAP GEMINI, FP	147,00	183,60	EUR	183,60		26.989,20	0,6%
CELLNEX TELECOM, SM	476,00	32,18	EUR	32,18		15.317,68	0,4%
CIE FINANCIERE RICHEMON, SW, CHF	73,00	134,20	CHF	140,77		10.276,51	0,2%
COMMERZBANK, GY	1.059,00	15,17	EUR	15,17		16.059,74	0,4%
CRH, LN, GBP	266,00	66,30	GBP	78,57		20.900,45	0,5%
DANONE, FP	191,00	60,14	EUR	60,14		11.486,74	0,3%
DEUTSCHE TELEKOM, GY	1.782,00	24,11	EUR	24,11		42.964,02	1,0%
DSM-FIRMENICH AG, NA	160,00	118,00	EUR	118,00		18.880,00	0,4%
ENEL, IM	7.722,00	6,59	EUR	6,59		50.918,87	1,2%
ENI SPA, IM	1.410,00	14,80	EUR	14,80		20.862,36	0,5%
ERSTE BANK AUSTRIA, AV	306,00	48,18	EUR	48,18		14.743,08	0,3%
ESPIRITO SANTO FINANCIAL GROUP, PL	1.064,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
ESSILOR, FP	117,00	211,70	EUR	211,70		24.768,90	0,6%
ESSITY AB, SS, SEK	391,00	301,50	SEK	25,96		10.151,69	0,2%
FERRARI NV, IM	66,00	380,30	EUR	380,30		25.099,80	0,6%
FERROVIAL SE, SM	327,00	37,00	EUR	37,00		12.099,00	0,3%
FINECOBANK SPA, IM	1.591,00	15,70	EUR	15,70		24.978,70	0,6%
HEIDELBERCEMENT, GY	196,00	96,64	EUR	96,64		18.941,44	0,4%
HERMES, FP	24,00	2.023,00	EUR	2.023,00		48.552,00	1,1%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA, SM	659,00	44,86	EUR	44,86		29.562,74	0,7%
INFINEON, GY	234,00	32,03	EUR	32,03		7.493,85	0,2%
ING Groep, NA	2.316,00	16,75	EUR	16,75		38.793,00	0,9%
L' OREAL, FP	99,00	400,40	EUR	400,40		39.639,60	0,9%
LVMH, FP	134,00	652,90	EUR	652,90		87.488,60	2,0%
MERCEDES-BENZ GROUP AG, GY	404,00	61,10	EUR	61,10		24.684,40	0,6%
MERCK KGAA, GY	95,00	166,05	EUR	166,05		15.774,75	0,4%
MICHELIN, FP	272,00	36,59	EUR	36,59		9.952,48	0,2%
MUNCHENER RUCK, GY	78,00	456,20	EUR	456,20		35.583,60	0,8%
NESTE OYJ, FH	251,00	18,71	EUR	18,71		4.694,96	0,1%
PERNOD-RICARD, FP	131,00	124,00	EUR	124,00		16.244,00	0,4%
PROSUS NV, NA	521,00	32,12	EUR	32,12		16.731,92	0,4%
PUIG BRANDS SA-B, SM	598,00	25,78	EUR	25,78		15.416,44	0,4%

Designação	Quantidade	Cotação Moeda Origem	Moeda	Cotação (EUR)	Juro Decorrido (EUR)	Montante Global (EUR)	Peso
RWE, GY	420,00	34,35	EUR	34,35		14.427,00	0,3%
SAFRAN, FP	74,00	203,10	EUR	203,10		15.029,40	0,4%
SANOFI-SYNTHELABO, FP	498,00	95,33	EUR	95,33		47.474,34	1,1%
SAP, GY	348,00	195,06	EUR	195,06		67.880,88	1,6%
SCHNEIDER, FP	291,00	222,85	EUR	222,85		64.849,35	1,5%
SIEMENS, GY	417,00	169,68	EUR	169,68		70.756,56	1,7%
SOCIETE GENERALE, FP	743,00	23,97	EUR	23,97		17.809,71	0,4%
SPIE SA, FP	282,00	35,72	EUR	35,72		10.073,04	0,2%
ST.GOBAIN, FP	272,00	79,44	EUR	79,44		21.607,68	0,5%
STELLANTIS NV, IM	1.358,00	15,40	EUR	15,40		20.915,92	0,5%
STMICROELECTRONICS, FP	534,00	30,60	EUR	30,60		16.340,40	0,4%
THALES (Ex -THOMSON), FP,FRF)	94,00	146,90	EUR	146,90		13.808,60	0,3%
TOTALENERGIES SE, FP	932,00	62,48	EUR	62,48		58.231,37	1,4%
UNICREDIT, IM	1.215,00	37,96	EUR	37,96		46.115,33	1,1%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV, NA	649,00	21,99	EUR	21,99		14.271,51	0,3%
VEOLIA ENVIRONNEMENT, FP	578,00	29,04	EUR	29,04		16.785,12	0,4%
VINCI, FP	297,00	105,55	EUR	105,55		31.348,35	0,7%
VONOVIA SE, GY	649,00	28,47	EUR	28,47		18.477,03	0,4%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					0,00	30.576,52	0,7%
1.3.4. Acções					0,00	30.576,52	0,7%
ASHTREAD GROUP, LN, GBP	137,00	55,90	GBP	66,25		9.075,97	0,2%
OCADO, LN, GBP	950,00	4,05	GBP	4,80		4.563,12	0,1%
RECKITT BENCKISER, LN, GBP	151,00	41,77	GBP	49,50		7.474,84	0,2%
SHELL PLC, NA	280,00	33,80	EUR	33,80		9.462,60	0,2%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	703.567,09	16,5%
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	703.567,09	16,5%
AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM-I CAP	2,14	11.404,23	EUR	11.404,23		24.405,05	0,6%
BNP EURO CORPORATE BD-I (FIM)	101,55	214,25	EUR	214,25		21.756,87	0,5%
GROUPAMA MONETAIRE	0,11	225.103,42	EUR	225.103,42		25.661,79	0,6%
ISHARES CORE EURO GOVT BOND, FIM, ETF	2.338,00	110,83	EUR	110,83		259.120,54	6,1%
ISHARES EUROS TOX UCITS ETF DE (FIM), ETF	907,00	50,88	EUR	50,88		46.148,16	1,1%
VONTOBEL-EUR CRP MID YLD-I (FIM)	128,58	168,30	EUR	168,30		21.639,17	0,5%
XUSD TREASURIES EUR, FIM, ETF	3.243,00	94,00	EUR	94,00		304.835,51	7,1%
4. Imobiliário					0,00	210.692,04	4,9%
4.2. Unidades De Participação De Fundos De Investimento Imobiliário					0,00	210.692,04	4,9%
FUNDIMO (FII)	24.590,00	8,57	EUR	8,57		210.692,04	4,9%
5. Liquidez					0,00	103.811,02	2,4%
5.1. À Vista					0,00	103.811,02	2,4%
Depósitos à Ordem					0,00	103.811,02	2,4%
9. Outros Activos					0,00	10.928,98	0,3%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	10.928,98	0,3%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	242,08	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	260,98	0,0%
Impostos a Regularizar					0,00	16.800,60	0,4%
Comissões					0,00	-6.374,68	-0,1%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO

VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO

4.270.397,20

705.692,91

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.