

LEVE DUO

30 setembro 2025

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	Peso
Parte I - Valores Patrimoniais					4.904.028,21	255.123.629,69	100,0%
1. Valores Mobiliários Cotados					4.904.028,21	248.822.276,51	97,5%
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					358.129,98	28.334.219,98	11,1%
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					358.129,98	28.334.219,98	11,1%
PGB, 1.95%, 15/06/2029, GOVT	3.000.000,00	99,02%	EUR	99,02%	17.149,33	2.987.689,33	1,2%
PGB, 3.875%, 15/02/2030, GOVT	5.000.000,00	106,31%	EUR	106,31%	120.496,59	5.436.146,59	2,1%
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	10.000.000,00	103,14%	EUR	103,14%	190.993,15	10.504.893,15	4,1%
REGIAO AUTONOMA ACORES, 1.006%, 15/06/2029, GOVT	10.000.000,00	93,76%	EUR	93,76%	29.490,91	9.405.490,91	3,7%
1.1.4. Acções					0,00	44.920,80	0,0%
REN, PL	14.680,00	3,06	EUR	3,06		44.920,80	0,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					4.223.570,34	196.626.008,52	77,1%
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					3.871.344,71	177.392.378,01	69,5%
BTPS, 0.35%, 17/11/2028, GOVT	2.000.000,00	95,21%	EUR	95,21%	4.434,77	1.908.554,77	0,7%
BTPS, 2.65%, 01/12/2027, GOVT	5.000.000,00	100,89%	EUR	100,89%	43.804,64	5.088.254,64	2,0%
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	14.000.000,00	106,73%	EUR	106,73%	53.273,49	14.996.033,49	5,9%
BTPS, 5.25%,01/11/29, GOVT	4.000.000,00	110,60%	EUR	110,60%	87.309,76	4.511.469,76	1,8%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	14.000.000,00	108,72%	EUR	108,72%	375.869,49	15.596.809,49	6,1%
JUNTA DE ANDALUCIA, 1.375%, 30/04/2029, GOVT	1.590.000,00	95,95%	EUR	95,95%	9.291,56	1.534.848,86	0,6%
JUNTA DE CASTILLA Y LEON, 1.2%, 13/10/2026, GOVT	20.000.000,00	98,79%	EUR	98,79%	231.452,05	19.989.452,05	7,8%
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	900.000,00	96,88%	EUR	96,88%	5.926,76	877.837,76	0,3%
SPGB, 0.1%, 30/04/2031, GOVT	3.000.000,00	86,85%	EUR	86,85%	1.257,53	2.606.817,53	1,0%
SPGB, 5.15%, 31/10/2028, GOVT	24.500.000,00	108,43%	EUR	108,43%	1.154.587,67	27.720.672,67	10,9%
SPGB, 5.75%, 30/07/2023, GOVT	30.000.000,00	118,01%	EUR	118,01%	293.013,70	35.696.613,70	14,0%
SPGB, 6%, 31/01/2029, GOVT	40.500.000,00	111,74%	EUR	111,74%	1.611.123,29	46.865.013,29	18,4%
1.2.3. Obrigações Diversas					352.225,63	19.233.630,51	7,5%
ACCOR, 2.375%, 29/11/2028, CORP, CALL	3.500.000,00	98,36%	EUR	98,36%	69.460,62	3.511.955,62	1,4%
ALD, 4.25%, 18/01/2027, CORP	1.500.000,00	102,20%	EUR	102,20%	44.537,67	1.577.537,67	0,6%
BANCO SANTANDER, VAR, 18/10/2027, CORP, CALL	2.000.000,00	102,24%	EUR	102,24%	87.938,36	2.132.658,36	0,8%
BBVA, 0.5%, 14/01/2027, CORP	2.600.000,00	97,59%	EUR	97,59%	9.224,66	2.546.434,66	1,0%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0%, 25/05/2029, CORP	1.000.000,00	91,19%	EUR	91,19%	0,00	911.870,00	0,4%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 0,6%, 25/11/2029, CORP	1.000.000,00	92,07%	EUR	92,07%	5.079,45	925.789,45	0,4%
CAISSE D'AMORT DETTE SOC, 2.75%, 25/02/2029, CORP	2.000.000,00	100,69%	EUR	100,69%	32.698,63	2.046.458,63	0,8%
CREDIT AGRICOLE, 2.85%, 27/04/2026, CORP	175.000,00	100,12%	EUR	100,12%	880,94	176.082,19	0,1%
FRESENIUS, 4.25%, 28/05/2026, CORP, CALL	500.000,00	101,01%	EUR	101,01%	7.277,40	512.322,40	0,2%
RYANAIR DAC, 0.875%, 25/05/2026, CORP	939.000,00	99,12%	EUR	99,12%	2.881,32	933.589,95	0,4%
SECURITAS TREASURY IRELAND, 4.375%, 06/03/2029, CORP, CALL	3.700.000,00	104,51%	EUR	104,51%	92.246,58	3.958.931,58	1,6%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					37.295,08	2.575.545,08	1,0%
1.3.1. Títulos De Dívida Pública					37.295,08	2.575.545,08	1,0%
BTPS, 3%, 01/10/2029, GOVT	2.500.000,00	101,53%	EUR	101,53%	37.295,08	2.575.545,08	1,0%
1.3.3. Obrigações Diversas					285.032,81	21.241.582,13	8,3%
ASHTeAD, 4%, 01/05/2028, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	99,19%	USD	84,48%	28.201,27	1.717.801,81	0,7%
BERKSHIRE, 2.15%, 15/03/2028, CORP, CALL	400.000,00	99,31%	EUR	99,31%	4.688,77	401.916,77	0,2%
DELTA AIR LINES, 4.5%, 20/10/2025, CORP, USD, SINK, 144A	166.375,00	99,94%	USD	85,12%	1.239,91	142.859,17	0,1%
ENERGY TRANSFER, 4.2%, 15/04/2027, CORP, USD, CALL	2.000.000,00	99,89%	USD	85,07%	32.791,08	1.734.281,59	0,7%
FREEPORT-MCMORAN, 4.125%, 01/03/2028, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	99,41%	USD	84,67%	2.830,18	849.521,26	0,3%
IQVIA, 5%, 15/10/2026, CORP, USD, CALL, 144A	3.000.000,00	99,88%	USD	85,07%	58.555,49	2.610.714,59	1,0%
LITHIA MOTORS, 4.625%, 15/12/2027, CORP, USD, CALL 144A	2.000.000,00	99,02%	USD	84,34%	22.978,59	1.709.717,37	0,7%
MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL	3.000.000,00	100,22%	USD	85,36%	43.783,52	2.604.655,68	1,0%
MEITUAN, 2.125%, 28/10/2025, CORP, USD, CALL	200.000,00	99,82%	USD	85,02%	1.528,36	171.568,39	0,1%
OPEN TEXT, 6.9%, 01/12/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	104,07%	USD	88,64%	29.139,34	1.358.723,70	0,5%
RADIAN GROUP, 4.875%, 15/03/2027, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	100,32%	USD	85,44%	1.730,05	856.154,71	0,3%
SINOCHEN OFFSHORE, 1.625%, 29/10/2025, CORP, USD	1.000.000,00	99,78%	USD	84,99%	5.805,28	855.673,26	0,3%
SMITHFIELD FOODS, 4.25%, 01/02/2027, CORP, USD, CALL, 144A	1.000.000,00	99,38%	USD	84,65%	5.932,44	852.402,08	0,3%
TOWER BERSAMA, 2.75%, 20/01/2026, CORP, CALL, USD	1.800.000,00	99,41%	USD	84,67%	8.197,77	1.532.241,72	0,6%
TRITON CONTAINER, 2.05%, 15/04/2026, CORP, USD, CALL, 144A	2.000.000,00	98,73%	USD	84,09%	16.005,15	1.697.821,01	0,7%
UNITED RENTALS, 4.875%, 15/01/2028, CORP, USD, CALL	2.500.000,00	99,75%	USD	84,96%	21.625,61	2.145.529,02	0,8%
1.3.4. Acções					0,00	3.870.756,03	1,5%
CHONGQING RURAL COMMERCIAL, HK, HKD	5.884.000,00	6,01	HKD	0,66		3.870.756,03	1,5%
2. Valores Não Cotados					0,00	0,00	0,0%
2.1. Valores Mobiliários Nacionais					0,00	0,00	0,0%
2.1.4. Acções					0,00	0,00	0,0%
BES, PL (EM LIQUIDACAO)	99.815,00	0,00	EUR	0,00		0,00	0,0%
3. Unidades De Participação De Instituições De Investimento Colectivo					0,00	6,56	0,0%
3.1. Fundos Harmonizados					0,00	6,56	0,0%
AXA WRLD EUR INF PLS-IEURACC (FIM)	0,06	115,09	EUR	115,09		6,56	0,0%
5. Liquidez					0,00	982.345,92	0,4%
5.1. À Vista					0,00	982.345,92	0,4%
Depósitos à Ordem					0,00	982.345,92	0,4%
5.2. A Prazo					0,00	326.036,97	0,1%
Depósitos e Outros Equiparados					0,00	326.036,97	0,1%
7. Operações Com Produtos Derivados					0,00	-41.450,90	0,0%
7.1. Em Mercado Regulamentado					0,00	-41.450,90	0,0%
7.1.1. Futuros					0,00	-41.450,90	0,0%
CMARGEM_FX_SG_SET2025_USD					0,00	-41.450,90	0,0%
EURUSD FX CURR FUT MAR26	132,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
7.2. Fora De Mercado Regulamentado					0,00	113.159,10	0,0%
7.2.1. Forwards					0,00	113.159,10	0,0%
FORWARD EUR vs USD_BNP (10000000 USD) (FW-EUR/USD-11/09/2025-10/09/2026)	1,00	132.860,10	USD	113.159,10		113.159,10	0,0%
9. Outros Activos					0,00	1.050.499,50	0,4%
9.1. Outros Devedores E Credores					0,00	-225,84	0,0%
Juros de D.O. a Regularizar					0,00	-225,84	0,0%
Transacções a Liquidar					0,00	1.050.725,34	0,4%

VALOR TOTAL DA CARTEIRA	255.123.629,69
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO	0,00
VALOR UNITÁRIO UNIDADE PARTICIPAÇÃO	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.