FIDELIDADE
SEGUROS DESDE 1808

IB LEVE I

31 dezembro 2023

O produto LEVE I teve o início da comercialização em 13/03/2008. 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					**905.931,89**	**66.944.702,29**	**100,0%**
1. Valores Mobiliários Cotados					**905.931,89**	**64.973.773,33**	**97,1%**
1.1. Mercado Cotações Oficiais Portugal					**235.327,83**	**8.705.807,83**	**13,0%**
1.1.1. Títulos De Dívida Pública					**235.327,83**	**8.705.807,83**	**13,0%**
PGB, 4.125%, 14/04/2027, GOVT	8.000.000,00	105,88%	EUR	105,88%	235.327,83	8.705.807,83	13,0%
1.2. Mercado Cotações Oficiais U.E.					**531.788,81**	**42.447.904,35**	**63,4%**
1.2.1. Títulos De Dívida Pública					**491.247,84**	**36.632.575,84**	**54,7%**
BTPS, 3.4%. 01/04/2028, GOVT	2.750.000,00	101,92%	EUR	101,92%	23.247,27	2.826.157,27	4,2%
BTPS, 3.8%. 01/08/2028, GOVT	2.000.000,00	103,52%	EUR	103,52%	31.391,30	2.101.731,30	3,1%
BTPS, 4.75%, 01/09/2028, GOVT	21.000.000,00	107,75%	EUR	107,75%	331.586,52	22.958.456,52	34,3%
BTPS, 6.5%, 01/11/2027, GOVT	2.400.000,00	113,18%	EUR	113,18%	25.714,28	2.742.082,28	4,1%
MADRID, 1.571%, 30/04/2029, GOVT	2.000.000,00	93,91%	EUR	93,91%	21.032,51	1.899.152,51	2,8%
SPGB, 0,8%, 30/07/2029, GOVT	1.500.000,00	90,72%	EUR	90,72%	5.049,18	1.365.789,18	2,0%
SPGB, 5.75%, 30/07/2032, GOVT	2.200.000,00	122,09%	EUR	122,09%	53.226,78	2.739.206,78	4,1%
1.2.3. Obrigações Diversas					**40.540,97**	**5.815.328,51**	**8,7%**
AERCAP IRELAND, 6.1%, 15/01/2027, CORP, USD, CALL	1.000.000,00	102,15%	USD	92,44%	14.720,97	939.146,31	1,4%
EU, 0,8%, 04/07/2025, CORP	2.000.000,00	97,04%	EUR	97,04%	7.868,85	1.948.728,85	2,9%
LEASEPLAN CORP, 0.25%, 07/09/2026, CORP	1.300.000,00	91,90%	EUR	91,90%	1.021,17	1.195.708,17	1,8%
SOCIETE GENERALE, 2.125%, 27/09/2028, CORP	1.400.000,00	94,48%	EUR	94,48%	7.721,99	1.330.399,99	2,0%
WPP FINANCE, 4.125%, 30/05/2028, CORP, CALL	380.000,00	103,19%	EUR	103,19%	9.207,99	401.345,19	0,6%
1.3. Mercado Cotações Oficiais Não Membro Da U.E.					**138.815,25**	**13.820.061,15**	**20,6%**
1.3.3. Obrigações Diversas					**138.815,25**	**13.820.061,15**	**20,6%**
ALIBABA, 3.6%, 28/11/2024, CORP, USD, CALL	1.300.000,00	98,30%	USD	88,96%	3.882,35	1.160.400,00	1,7%
DRAX, 6.625%, 01/11/2025, CORP, USD, CALL, 144A	2.260.000,00	99,00%	USD	89,60%	22.582,96	2.047.461,15	3,1%
DUKE ENERGY CORP, 3.1%, 15/06/2028, CORP, CALL	400.000,00	98,66%	EUR	98,66%	6.742,08	401.374,08	0,6%
FORD MOTOR CREDIT, 5.125%, 20/02/2029, CORP	2.000.000,00	104,71%	EUR	104,71%	10.390,41	2.104.530,41	3,1%
HUAFA 2019, 4.25%, 03/07/2024, CORP, USD	1.500.000,00	98,19%	USD	88,86%	28.525,64	1.361.435,14	2,0%
MATTEL INC, 5.875%, 15/12/2027, CORP, USD, 144A, CALL	2.000.000,00	99,92%	USD	90,42%	4.725,99	1.813.160,38	2,7%
MPT OPER, 5%, 15/10/2027, CORP, USD, CALL	2.650.000,00	82,04%	USD	74,24%	25.314,23	1.992.693,41	3,0%
NRG ENERGY, 3.75%, 15/06/2024, CORP, USD, CALL, 144A	725.000,00	98,74%	USD	89,36%	1.093,51	648.941,70	1,0%
SIRIUS XM RADIO, 3.125%, 01/09/2026, CORP, USD, CALL,	1.500.000,00	94,52%	USD	85,54%	14.140,28	1.297.271,51	1,9%
SPIRIT LOYALTY, 8%, 20/09/2025, CORP, USD, CALL, 144A	1.500.000,00	71,56%	USD	64,76%	21.417,80	992.793,37	1,5%
5. Liquidez						**1.970.928,95**	**2,9%**
5.1. À Vista						**1.970.928,95**	**2,9%**
Depósitos à Ordem						1.970.928,95	2,9%
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 MAR24	99,00	0,00	USD	0,00		0,00	0,0%
9. Outros Activos						**0,01**	**0,0%**
9.1. Outros Devedores E Credores						**0,01**	**0,0%**
Juros de D.O. a Regularizar						0,01	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.