

Fondo Pensione Dipendenti della Findomestic Banca S.p.A. - Comparto Linea Conservativa



Report al 30/09/2024

Portafoglio n. 676057

Informazioni anagrafiche

Portafoglio n.	676057		
Data inizio mandato	22/11/2013		
Banca d'appoggio	BFF Bank S.p.A.		
Service amministrativo	Previnet S.p.A.		
Relationship Manager	Antonio D'Angelo	Andrea Bernardi	
	Antonio.Dangelo@eurizoncapital.com	Andrea.Bernardi@eurizoncapital.com	
	02 88107142	02 88102029	
	335 6357690	335 7211249	

Portafoglio n. 676057

Dati di sintesi

Patrimonio inizio anno € 5.137.834,11

Patrimonio attuale € 6.669.759,19

Data inizio confronto benchmark 22/11/2013

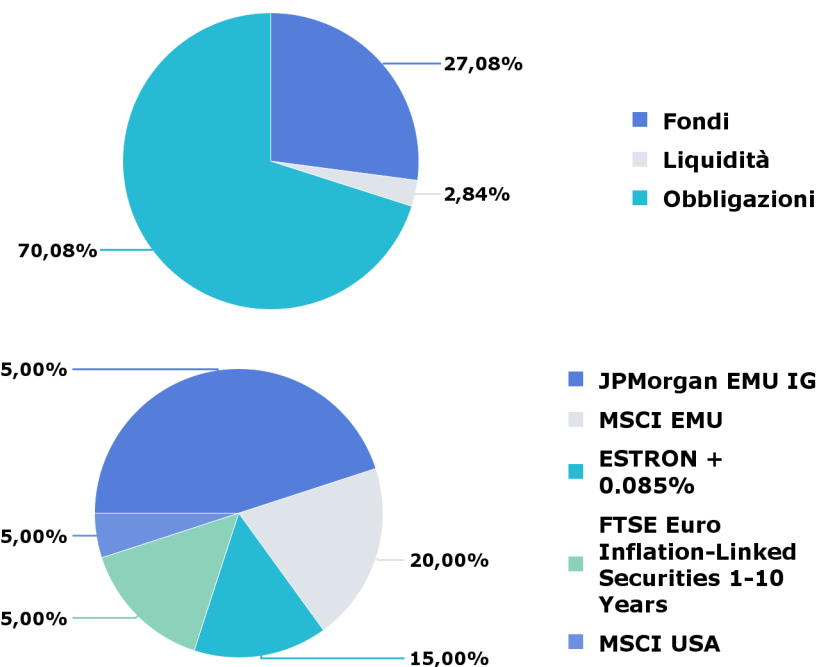
Data inizio validità benchmark attuale 19/05/2023

Ripartizione per strumento

	Valore PTF	Peso PTF
Obbligazioni	€ 4.674.361,91	70,08%
Azioni	-	-
Fondi	€ 1.806.019,53	27,08%
Opzioni	-	-
Liquidità	€ 189.377,75	2,84%
Totale	€ 6.669.759,19	100,00%

Indici del benchmark

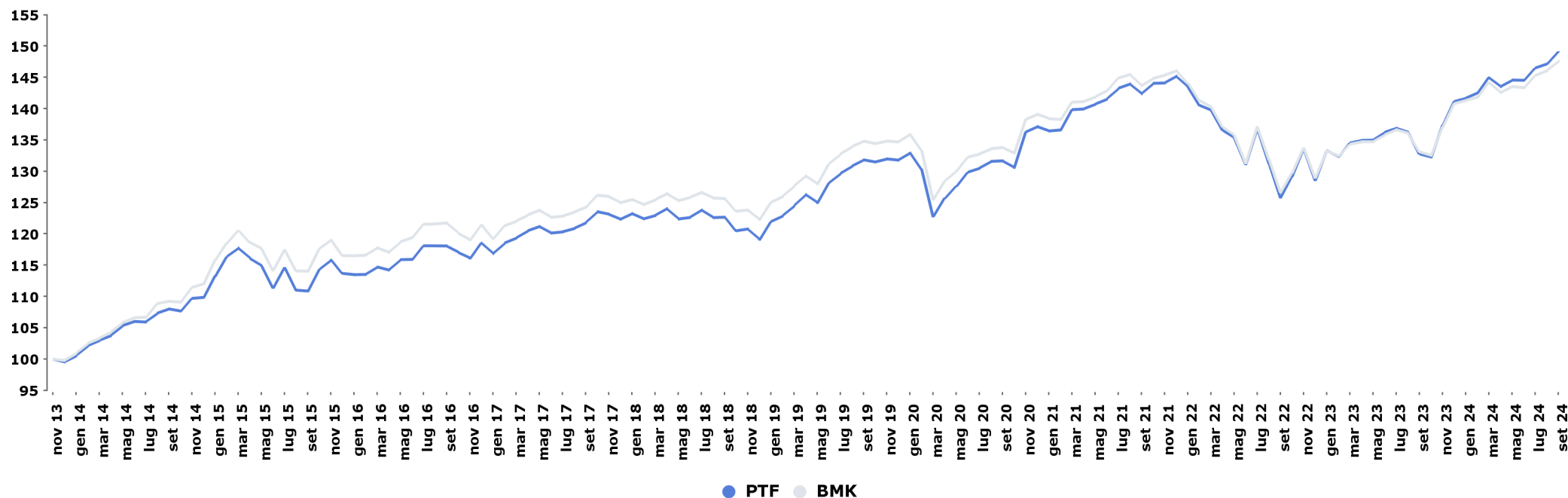
	Peso BMK
JPMorgan EMU IG	45,00%
MSCI EMU	20,00%
ESTRON + 0.085%	15,00%
FTSE Euro Inflation-Linked Securities 1-10 Years	15,00%
MSCI USA	5,00%
Totale	100,00%



Portafoglio n. 676057

Dati di sintesi

Andamento portafoglio vs benchmark



Performance da

	PTF	BMK	Delta
inizio confronto	49,51%	48,10%	1,41%
inizio anno	5,62%	4,83%	0,80%
inizio mese	1,28%	1,04%	0,25%

Indicatori di rischio

	PTF	BMK	Delta
Duration	4,11	3,90	0,21
Volatilità da inizio confronto	5,84%	5,66%	0,18%
Volatilità da inizio anno	3,27%	3,18%	0,09%
TEV ex-post*	0,40%		

* a 1 anno

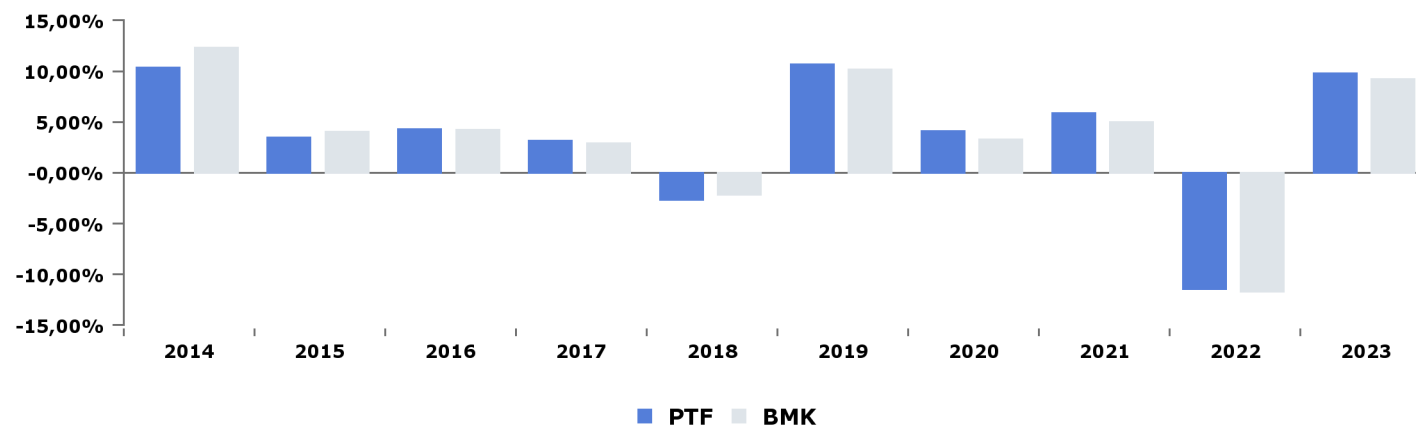
Il calcolo delle performance non tiene conto di eventuali periodi di sospensione.

Portafoglio n. 676057

Performance

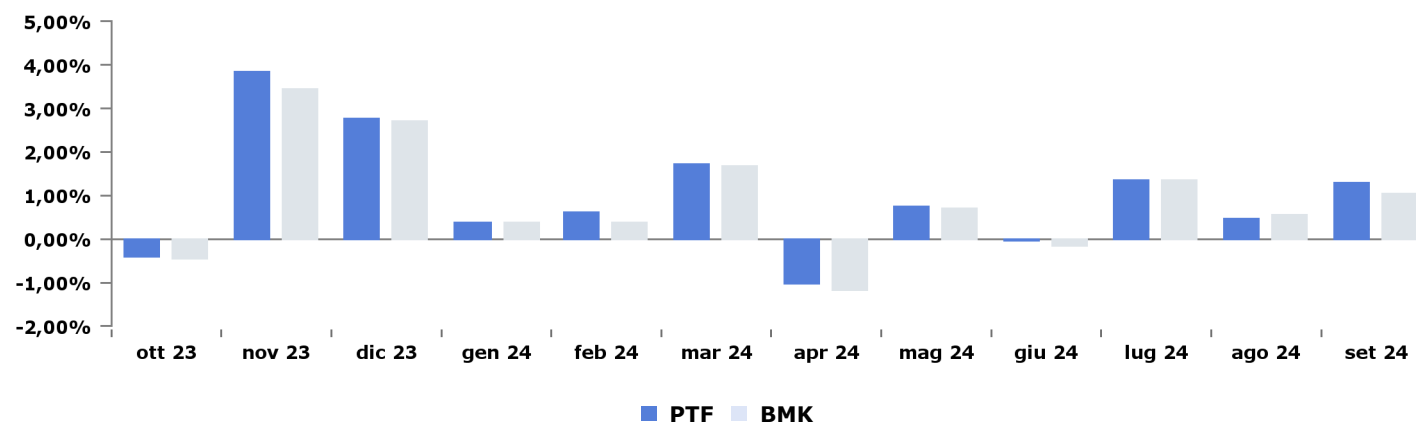
Performance annuali

	PTF	BMK	Delta
2023	9,77%	9,19%	0,58%
2022	-11,46%	-11,72%	0,26%
2021	5,87%	4,98%	0,89%
2020	4,08%	3,30%	0,78%
2019	10,66%	10,14%	0,51%
2018	-2,64%	-2,15%	-0,49%
2017	3,16%	2,89%	0,26%
2016	4,30%	4,22%	0,07%
2015	3,48%	4,01%	-0,53%
2014	10,37%	12,29%	-1,92%



Performance mensili ultimi mesi

	PTF	BMK	Delta
set 24	1,28%	1,04%	0,25%
ago 24	0,47%	0,55%	-0,08%
lug 24	1,35%	1,36%	-0,01%
giu 24	-0,03%	-0,15%	0,12%
mag 24	0,75%	0,70%	0,04%
apr 24	-1,03%	-1,17%	0,14%
mar 24	1,72%	1,67%	0,05%
feb 24	0,61%	0,38%	0,24%
gen 24	0,38%	0,37%	0,01%
dic 23	2,77%	2,71%	0,05%
nov 23	3,84%	3,44%	0,40%
ott 23	-0,40%	-0,45%	0,05%



Il calcolo delle performance non tiene conto di eventuali periodi di sospensione.

Portafoglio n. 676057

Misure statistiche

Indicatori di rischio sul portafoglio

	1Y	3Y
Information Ratio	3,43	0,74
Sharpe Ratio*	2,25	0,00
Max drawdown	-1,29%	-14,25%
Alpha ex-post	0,02%	0,01%
Beta ex-post	1,04	1,04
Semi TEV % ex-post	0,20%	0,57%
TEV ex-post	0,40%	0,86%
Alpha di Jensen ex-post	0,97%	0,68%

* l'indice utilizzato è il Bloomberg Barclays Euro Treasury Bills Index

Altre misure

Turnover anno 2023	103,26%
Turnover ago 24	4,23%
Turnover ultimi 30 gg	18,03%
Turnover ultimi 12 mesi	101,05%
Turnover da inizio anno	75,25%
Beta ex-ante	1,07
TEV ex-post semestrale ann.**	0,41%
TEV ex-post semestrale sem.***	0,29%
Historical daily VaR 99%****	0,73%

** è calcolata su 6 mesi di storia annualizzati

*** è calcolata su 6 mesi di storia semestralizzati

**** è il VaR storico giornaliero, livello di confidenza 99%

Indicatori di rischio portafoglio vs benchmark

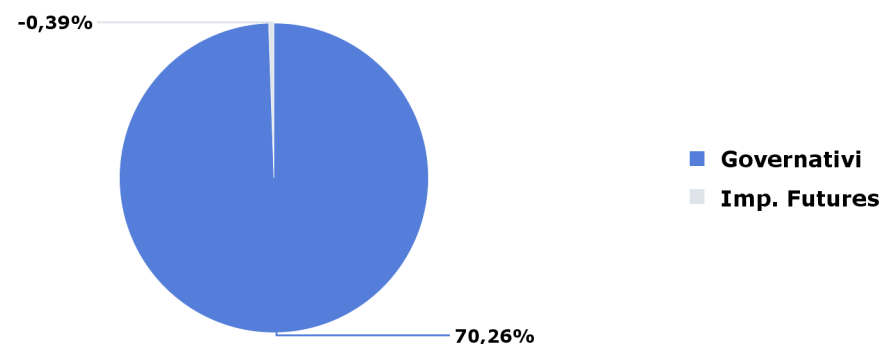
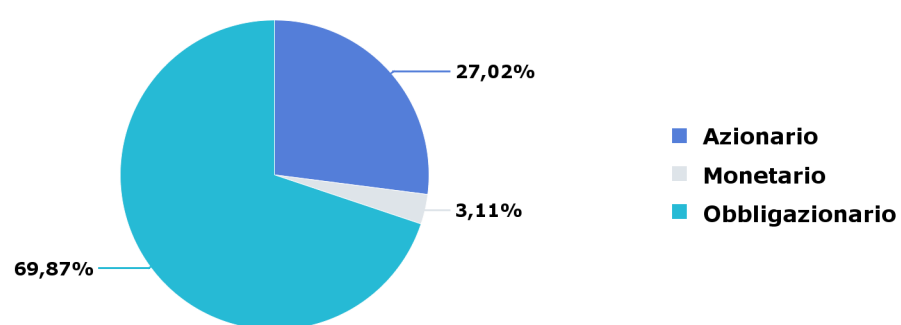
	PTF	BMK
Duration	4,11	3,90
Volatilità inizio confronto	5,84%	5,66%
Volatilità 5 anni	6,60%	6,34%
Volatilità 3 anni	6,23%	5,96%
Volatilità 1 anno	3,84%	3,68%
Volatilità inizio anno	3,27%	3,18%

Portafoglio n. 676057

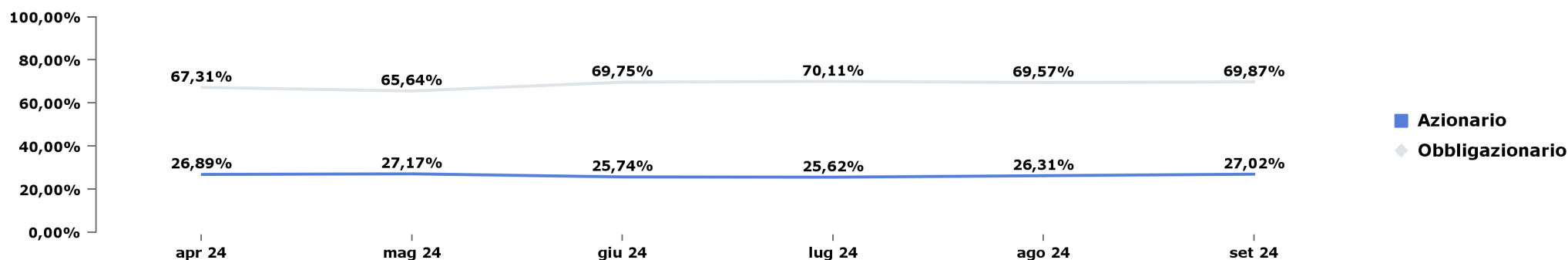
Portafoglio (1/2)

Asset allocation

	Valore PTF	Obbligazionario		Azionario		Monetario	
		Valore PTF	Peso PTF	Valore PTF	Peso PTF	Valore PTF	Peso PTF
30/09/2024	k€ 6.670	k€ 4.660	69,87%	k€ 1.802	27,02%	k€ 208	3,11%



Evoluzione peso obbligazionario e azionario

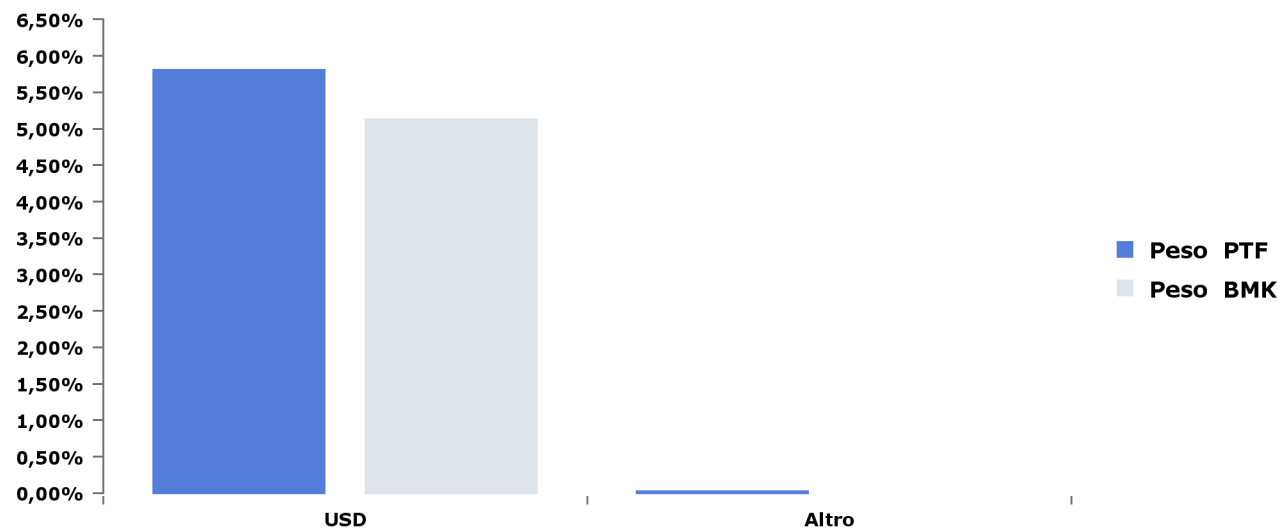


Portafoglio n. 676057

Portafoglio (2/2)

Divise

	Peso PTF	Peso BMK	Delta
EUR	94,17%	94,87%	-0,71%
USD	5,81%	5,13%	0,68%
Altro	0,03%	0,00%	0,03%
Totale	100,00%	100,00%	0,00%

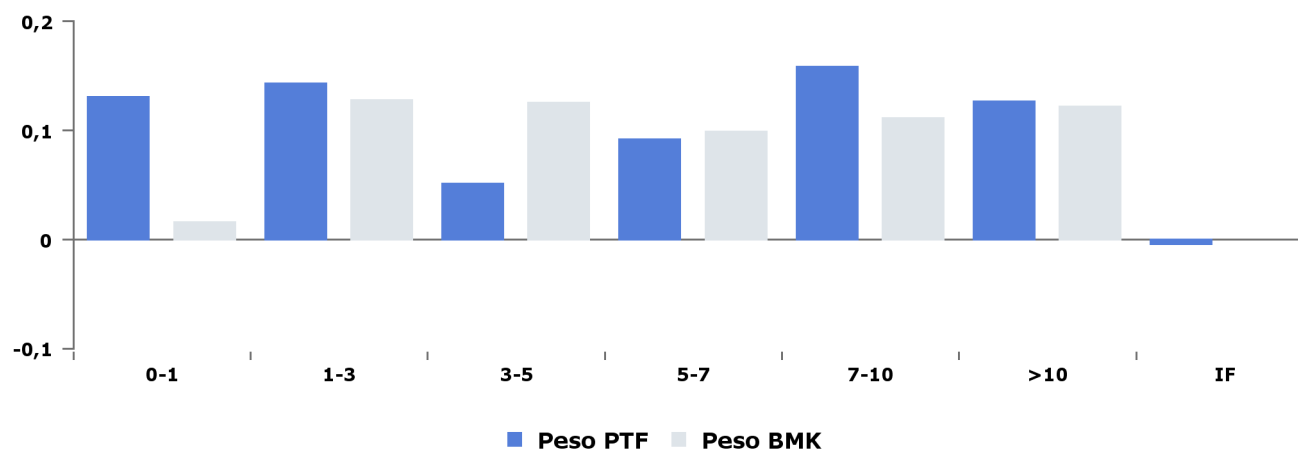


Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (1/9)

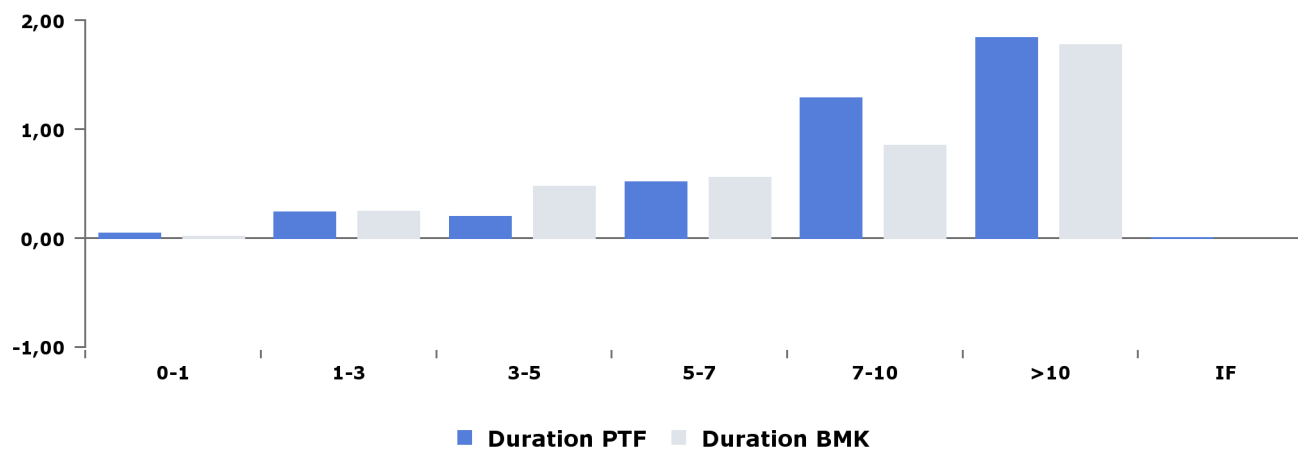
Obbligazionario: scadenza per tratti di curva

	Peso PTF	Peso BMK	Delta
0-1	13,10%	1,58%	11,52%
1-3	14,33%	12,80%	1,53%
3-5	5,13%	12,57%	-7,44%
5-7	9,18%	9,87%	-0,69%
7-10	15,86%	11,13%	4,73%
>10	12,66%	12,16%	0,50%
IF	-0,39%	0,00%	-0,39%
Totale	69,87%	60,10%	9,77%



Obbligazionario: duration per tratti di curva

	Duration PTF	Duration BMK	Delta
0-1	0,04	0,01	0,03
1-3	0,24	0,24	0,00
3-5	0,19	0,47	-0,28
5-7	0,51	0,55	-0,04
7-10	1,28	0,85	0,43
>10	1,83	1,77	0,06
IF	0,00	0,00	0,00
Totale	4,11	3,90	0,21

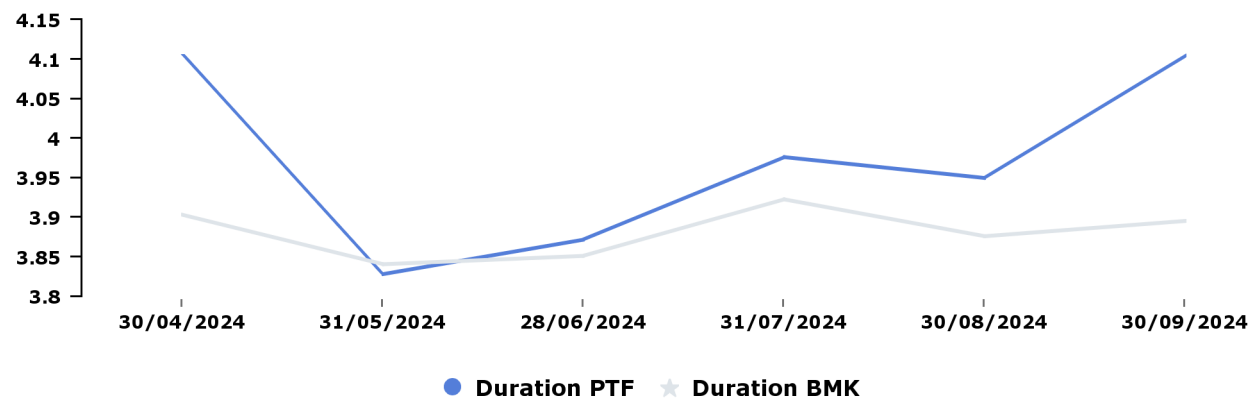


Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (2/9)

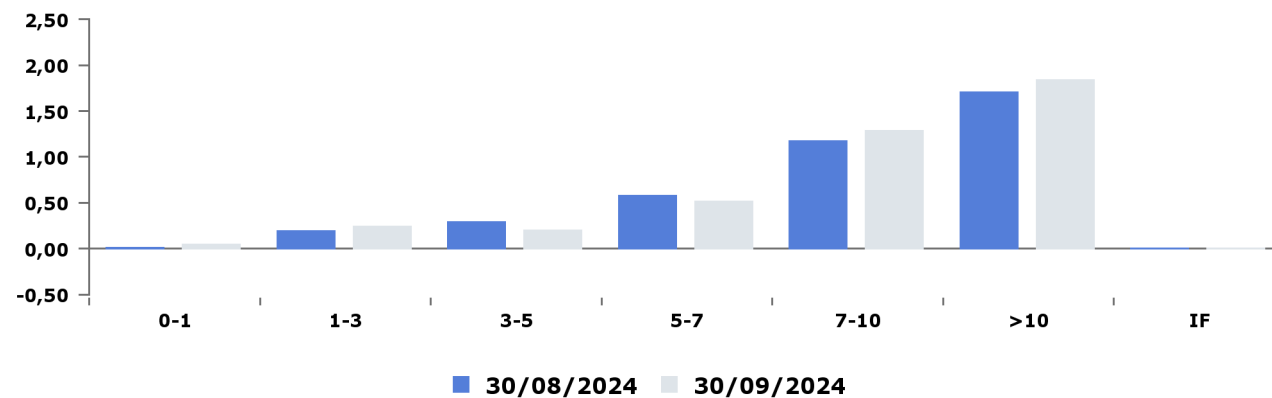
Obbligazionario: evoluzione duration

	Duration PTF	Duration BMK	Delta
30/09/2024	4,11	3,90	0,21
30/08/2024	3,95	3,88	0,07
31/07/2024	3,98	3,92	0,05
28/06/2024	3,87	3,85	0,02
31/05/2024	3,83	3,84	-0,01
30/04/2024	4,11	3,90	0,20



Obbligazionario: duration per tratti di curva vs mese precedente

	Duration PTF 30/09/2024	Delta
0-1	0,04	0,03
1-3	0,24	0,05
3-5	0,19	-0,10
5-7	0,51	-0,07
7-10	1,28	0,11
>10	1,83	0,13
IF	0,00	0,00
Totale	4,11	0,15



Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (3/9)

Obbligazionario: tipo emittente

	Governativi			di cui Inflation Linked			Garantiti / Sovranazionali			Corporate			Totale		
	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta
30/09/2024	70,26%	60,10%	10,16%	12,88%	14,83%	-1,94%	-	-	-	-	-	-	70,26%	60,10%	10,16%

Obbligazionario: scadenza - tipo emittente

	Governativi			di cui Inflation Linked			Garantiti / Sovranazionali			Corporate			Totale		
	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta
0-1	13,10%	1,58%	11,52%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	13,10%	1,58%	11,52%
1-3	14,33%	12,80%	1,53%	3,12%	3,52%	-0,40%	-	-	-	-	-	-	14,33%	12,80%	1,53%
3-5	5,13%	12,57%	-7,44%	2,31%	4,04%	-1,74%	-	-	-	-	-	-	5,13%	12,57%	-7,44%
5-7	9,18%	9,87%	-0,69%	4,06%	3,59%	0,47%	-	-	-	-	-	-	9,18%	9,87%	-0,69%
7-10	15,86%	11,13%	4,73%	3,40%	3,67%	-0,28%	-	-	-	-	-	-	15,86%	11,13%	4,73%
>10	12,66%	12,16%	0,50%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12,66%	12,16%	0,50%
Totale	70,26%	60,10%	10,16%	12,88%	14,83%	-1,94%	-	-	-	-	-	-	70,26%	60,10%	10,16%

Obbligazionario: duration - tipo emittente

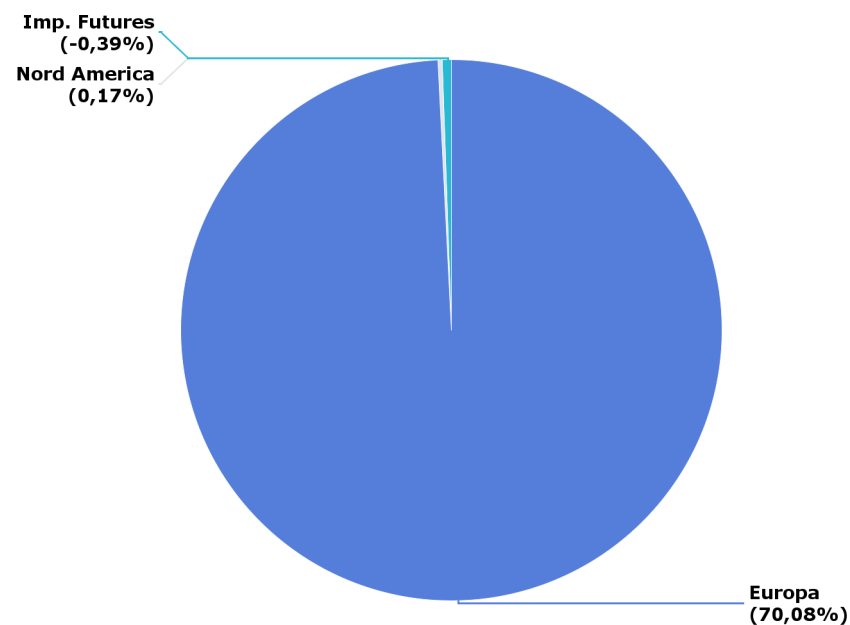
	Duration PTF	Duration BMK
Governativi	4,11	3,90
di cui Inflation Linked	0,66	0,72
Garantiti / Sovranazionali	-	-
Corporate	-	-

Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (4/9)

Obbligazionario: area geografica

	Peso PTF	Peso BMK	Delta
Europa	70,08%	60,10%	
AUSTRIA	2,01%	1,68%	0,34%
BELGIO	0,94%	2,43%	-1,49%
FINLANDIA	1,54%	0,78%	0,76%
FRANCIA	9,59%	17,54%	-7,95%
GERMANIA	9,23%	10,76%	-1,54%
IRLANDA	0,19%	0,70%	-0,51%
ITALIA	32,68%	14,04%	18,64%
OLANDA	2,43%	2,04%	0,39%
PORTOGALLO	1,55%	0,94%	0,61%
SPAGNA	9,92%	9,19%	0,73%
Nord America	0,17%	0,00%	
Imp. Futures	-0,39%	0,00%	
Imp. Futures	-0,39%	-	-0,39%

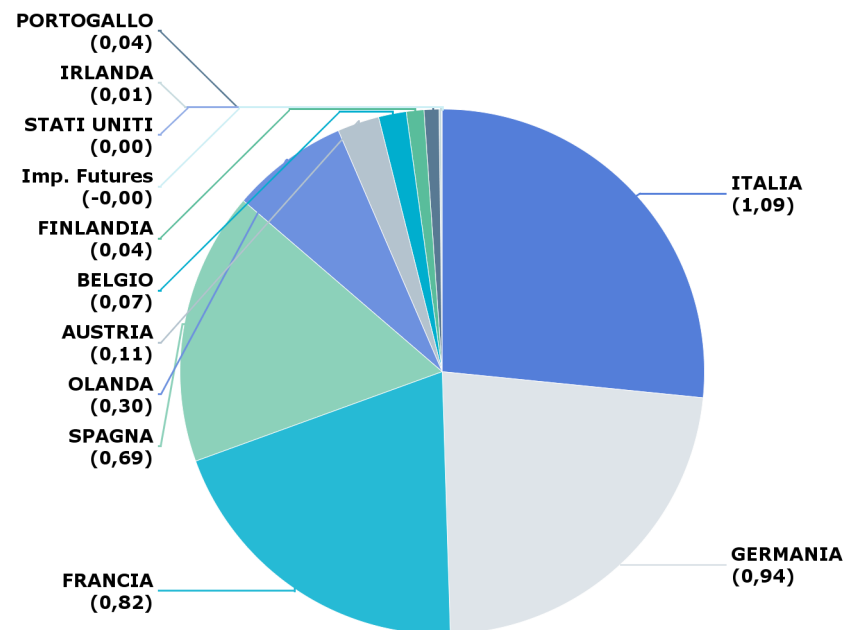


Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (5/9)

Obbligazionario: duration per paese

	Duration PTF	Duration BMK	Delta
Europa	4,10	3,90	0,21
ITALIA	1,09	0,82	0,27
GERMANIA	0,94	0,71	0,23
FRANCIA	0,82	1,09	-0,27
SPAGNA	0,69	0,59	0,10
OLANDA	0,30	0,16	0,13
AUSTRIA	0,11	0,14	-0,04
BELGIO	0,07	0,20	-0,13
FINLANDIA	0,04	0,06	-0,01
PORTOGALLO	0,04	0,06	-0,02
IRLANDA	0,01	0,06	-0,05
Nord America	0,00	0,00	0,00
Imp. Futures	0,00	0,00	0,00
Imp. Futures	0,00	0,00	0,00



Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (6/9)

Obbligazionario: paese tipo emittente

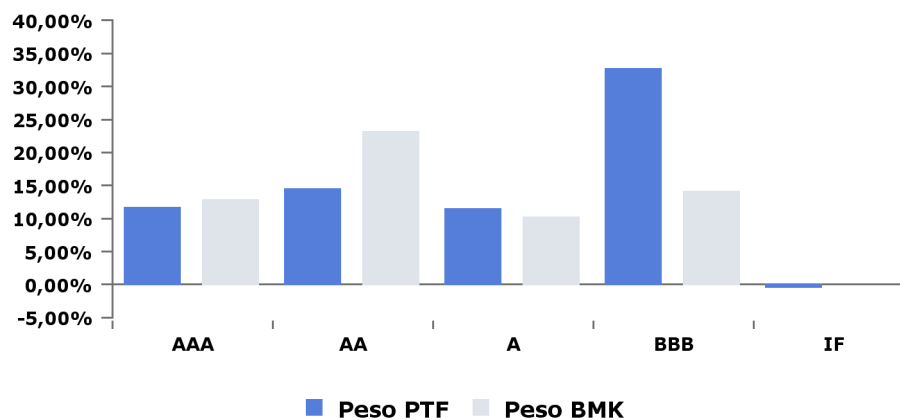
	Governativi			di cui Inflation Linked			Garantiti / sovrnazionali			Corporate		
	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta
Europa	70,08%	60,10%	9,98%	12,88%	14,83%	-1,94%	-	-	-	-	-	-
AUSTRIA	2,01%	1,68%	0,34%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BELGIO	0,94%	2,43%	-1,49%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FINLANDIA	1,54%	0,78%	0,76%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FRANCIA	9,59%	17,54%	-7,95%	4,96%	6,14%	-1,18%	-	-	-	-	-	-
GERMANIA	9,23%	10,76%	-1,54%	1,92%	2,24%	-0,33%	-	-	-	-	-	-
IRLANDA	0,19%	0,70%	-0,51%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITALIA	32,68%	14,04%	18,64%	3,97%	4,04%	-0,07%	-	-	-	-	-	-
OLANDA	2,43%	2,04%	0,39%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PORTOGALLO	1,55%	0,94%	0,61%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SPAGNA	9,92%	9,19%	0,73%	2,03%	2,40%	-0,37%	-	-	-	-	-	-
Nord America	0,17%	0,00%	0,17%	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (7/9)

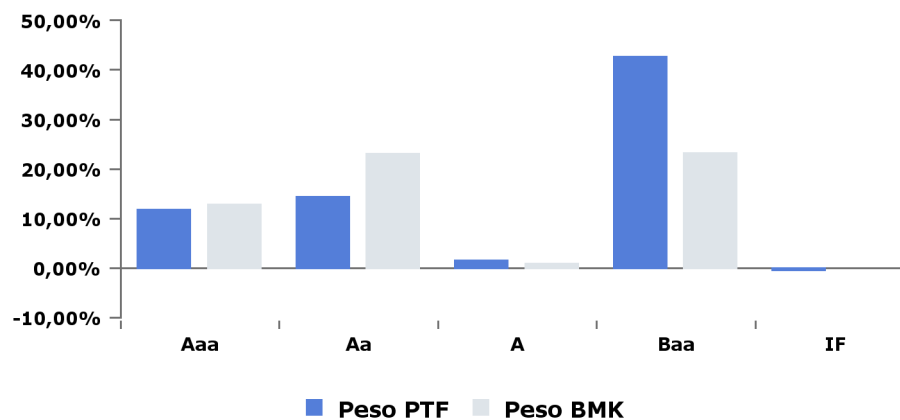
Obbligazionario Rating S&P

	Peso PTF	Peso BMK	Delta
AAA	11,66%	12,81%	-1,15%
AA	14,45%	23,12%	-8,67%
A	11,47%	10,13%	1,34%
BBB	32,68%	14,04%	18,64%
IF	-0,39%	0,00%	-0,39%
Totale	69,87%	60,10%	9,77%



Obbligazionario Rating Moody's

	Peso PTF	Peso BMK	Delta
Aaa	11,74%	12,81%	-1,07%
Aa	14,36%	23,12%	-8,76%
A	1,55%	0,94%	0,61%
Baa	42,61%	23,23%	19,38%
IF	-0,39%	0,00%	-0,39%
Totale	69,87%	60,10%	9,77%



Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (8/9)

Obbligazionario: Rating S&P - tipo emittente

Governativi				Garantiti / Sovranazionali			Corporate			Totale		
	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta
AAA	11,66%	12,81%	-1,15%	-	-	-	-	-	-	11,66%	12,81%	-1,15%
AA+	3,64%	2,46%	1,18%	-	-	-	-	-	-	3,64%	2,46%	1,18%
AA	1,13%	3,12%	-2,00%	-	-	-	-	-	-	1,13%	3,12%	-2,00%
AA-	9,68%	17,54%	-7,86%	-	-	-	-	-	-	9,68%	17,54%	-7,86%
A	9,92%	9,19%	0,73%	-	-	-	-	-	-	9,92%	9,19%	0,73%
A-	1,55%	0,94%	0,61%	-	-	-	-	-	-	1,55%	0,94%	0,61%
BBB	32,68%	14,04%	18,64%	-	-	-	-	-	-	32,68%	14,04%	18,64%
Totale	70,26%	60,10%	10,16%	-	-	-	-	-	-	70,26%	60,10%	10,16%

Portafoglio n. 676057

Portafoglio obbligazionario (9/9)

Obbligazionario: Rating Moody's - tipo emittente

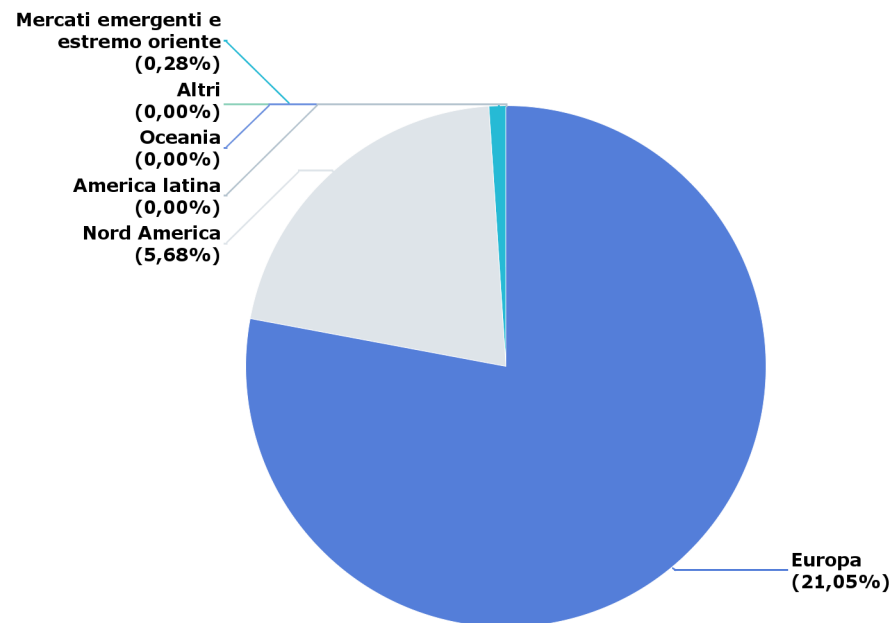
Governativi			Garantiti / Sovranazionali			Corporate			Totale		
Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta	Peso PTF	Peso BMK	Delta
Aaa	11,74%	12,81%	-1,07%	-	-	-	-	-	11,74%	12,81%	-1,07%
Aa1	3,56%	2,46%	1,10%	-	-	-	-	-	3,56%	2,46%	1,10%
Aa2	9,68%	17,54%	-7,86%	-	-	-	-	-	9,68%	17,54%	-7,86%
Aa3	1,13%	3,12%	-2,00%	-	-	-	-	-	1,13%	3,12%	-2,00%
A3	1,55%	0,94%	0,61%	-	-	-	-	-	1,55%	0,94%	0,61%
Baa1	9,92%	9,19%	0,73%	-	-	-	-	-	9,92%	9,19%	0,73%
Baa3	32,68%	14,04%	18,64%	-	-	-	-	-	32,68%	14,04%	18,64%
Totale	70,26%	60,10%	10,16%	-	-	-	-	-	70,26%	60,10%	10,16%

Portafoglio n. 676057

Portafoglio azionario (1/2)

Azionario: area geografica

	Peso PTF	Peso BMK	Delta
Europa	21,05%	19,66%	1,39%
FRANCIA	7,02%	6,62%	0,40%
GERMANIA	5,56%	5,35%	0,21%
OLANDA	2,52%	2,56%	-0,03%
SPAGNA	2,01%	1,70%	0,31%
ITALIA	1,63%	1,51%	0,12%
FINLANDIA	0,79%	0,62%	0,17%
BELGIO	0,69%	0,60%	0,09%
SVIZZERA	0,21%	0,16%	0,06%
IRLANDA	0,21%	0,19%	0,03%
AUSTRIA	0,14%	0,11%	0,03%
Altro	0,27%	0,26%	0,01%
Nord America	5,68%	5,12%	0,56%
America latina	0,00%	0,00%	0,00%
Mercati emergenti e estremo oriente	0,28%	0,22%	0,06%
Altri	0,00%	0,00%	0,00%
Oceania	0,00%	0,00%	0,00%

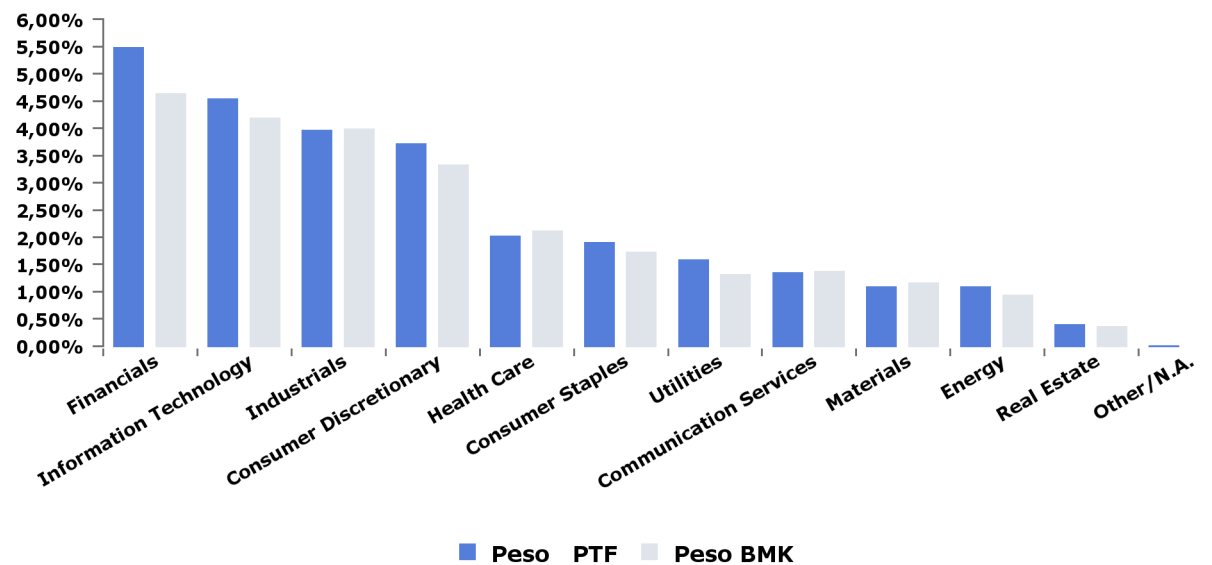


Portafoglio n. 676057

Portafoglio azionario (2/2)

Azionario: settore

	Peso PTF	Peso BMK	Delta
Financials	5,47%	4,63%	0,85%
Information Technology	4,53%	4,17%	0,36%
Industrials	3,95%	3,97%	-0,02%
Consumer Discretionary	3,70%	3,32%	0,38%
Health Care	2,01%	2,10%	-0,10%
Consumer Staples	1,89%	1,71%	0,18%
Utilities	1,58%	1,31%	0,27%
Communication Services	1,34%	1,36%	-0,02%
Materials	1,08%	1,15%	-0,07%
Energy	1,08%	0,93%	0,15%
Real Estate	0,38%	0,35%	0,04%
Other/N.A.	0,00%	0,00%	0,00%
Totale	27,02%	25,01%	2,01%



Portafoglio n. 676057

Strumenti in portafoglio

Obbligazioni

ISIN	Ticker Bloomberg	Denominazione	Tipo emittente	Rating Moody's	Paese	Duration	Tipo cedola	Divisa	Prezzo in Euro	Quantity	Controvalore	Costo di carico	Tipo tasso	Peso PTF
AT0000A2CQD2	ZP7632067	RAGB 0 02/20/30	Government	Aa1	AT	5,26	Fisso	EUR	€88,32	152.000	€134.238,89	83,00	Nominale	2,01%
BE0000333428	EK1192989	BGB 3 06/22/34	Government	Aa3	BE	8,3	Fisso	EUR	€102,58	35.000	€36.189,97	103,00	Nominale	0,54%
BE0000335449	EK7448872	BGB 1 06/22/31	Government	Aa3	BE	6,35	Fisso	EUR	€91,09	29.000	€26.495,26	98,00	Nominale	0,40%
DE0001030559	EK1581793	DBRI 0 1/2 04/15/30 I	Government	Aaa	DE	5,44	Fisso	EUR	€128,45	63.000	€81.104,78	130,00	Reale	1,22%
DE0001030567	EK7815401	DBRI 0.1 04/15/26 I/L	Government	Aaa	DE	1,51	Fisso	EUR	€124,70	7.000	€8.732,80	121,00	Reale	0,13%
DE0001030583	BN8684431	DBRI 0.1 04/15/33	Government	Aaa	DE	8,47	Fisso	EUR	€118,81	32.000	€38.035,39	117,00	Reale	0,57%
DE0001102424	AO2235429	DBR 0 1/2 08/15/27	Government	Aaa	DE	2,8	Fisso	EUR	€96,26	28.000	€26.969,04	96,00	Nominale	0,40%
DE0001102515	BJ3055610	DBR 0 05/15/35	Government	Aaa	DE	10,39	Fisso	EUR	€79,53	37.000	€29.426,48	76,00	Nominale	0,44%
DE0001102572	BR2469814	DBR 0 08/15/52	Government	Aaa	DE	27,21	Fisso	EUR	€51,21	102.000	€52.229,11	47,00	Nominale	0,78%
DE0001102598	BV9824384	DBR 1 05/15/38	Government	Aaa	DE	12,36	Fisso	EUR	€84,50	99.000	€84.033,26	81,00	Nominale	1,26%
DE0001135432	EI3229347	DBR 3,25%07/2042	Government	Aaa	DE	13,58	Fisso	EUR	€111,60	37.000	€41.580,06	109,00	Nominale	0,62%
DE000BU22023	ZF1451532	DBR 2.2 02/15/34	Government	Aaa	DE	8,27	Fisso	EUR	€100,94	247.000	€253.201,83	99,00	Nominale	3,80%
ES00000121S7	EH9842699	BONOS 4,7% 07/41	Government	Baa1	ES	11,91	Fisso	EUR	€116,95	87.000	€102.444,54	118,00	Nominale	1,54%
ES00000127C8	EK8232556	SPGBEI 1% 11/30 I/L	Government	Baa1	ES	5,92	Fisso	EUR	€127,47	38.000	€48.838,09	127,00	Reale	0,73%
ES00000128Q6	AM6067459	SPGB 2,35% 07/30/33	Government	Baa1	ES	7,81	Fisso	EUR	€96,69	131.000	€127.188,13	94,00	Nominale	1,91%
ES00000128S2	AN3598314	SPGBEI 0,65% 11/27 I	Government	Baa1	ES	3,1	Fisso	EUR	€125,20	33.000	€41.540,32	118,00	Reale	0,62%
ES0000012B88	AT2820591	SPGB 1,4% 07/28	Government	Baa1	ES	3,66	Fisso	EUR	€96,62	58.000	€56.178,10	101,00	Nominale	0,84%
ES0000012C12	AU4693654	SPGBEI 0,7% 11/33 I/	Government	Baa1	ES	8,76	Fisso	EUR	€120,81	37.000	€44.967,75	116,00	Reale	0,67%
ES0000012G00	BG2707340	SPGB 1 10/31/50	Government	Baa1	ES	20,73	Fisso	EUR	€57,13	75.000	€43.535,47	67,00	Nominale	0,65%
ES0000012G34	BJ0516218	SPGB 1 1/4 10/31/30	Government	Baa1	ES	5,67	Fisso	EUR	€92,89	53.000	€49.838,61	100,00	Nominale	0,75%
ES0000012G91	ZO8777807	SPGB 0 01/31/26	Government	Baa1	ES	1,3	Fisso	EUR	€96,86	152.000	€147.227,30	94,00	Nominale	2,21%
FI4000278551	AO9389500	RFGB 0,5% 09/27	Government	Aa1	FI	2,87	Fisso	EUR	€95,38	108.000	€103.029,35	96,00	Nominale	1,54%
FR0000188799	EC7356149	OAT 3,15% 07/32 I/L	Government	Aa2	FR	7,03	Fisso	EUR	€183,67	32.000	€59.063,61	195,00	Reale	0,89%
FR0010171975	ED8307479	OAT 4% 04/55	Government	Aa2	FR	17,76	Fisso	EUR	€108,49	44.000	€48.499,22	128,00	Nominale	0,73%
FR0011008705	EI5686858	FRTR 1,85% 07/27 I/L	Government	Aa2	FR	2,74	Fisso	EUR	€139,25	64.000	€89.414,50	142,00	Reale	1,34%
FR0011461037	EJ6098374	FRTR 3,25% 05/45	Government	Aa2	FR	14,64	Fisso	EUR	€98,46	56.000	€55.775,28	108,00	Nominale	0,84%
FR0011982776	EK3265163	FRTR 0,7% 07/30 I/L	Government	Aa2	FR	5,67	Fisso	EUR	€126,46	38.000	€48.115,32	130,00	Reale	0,72%
FR0013313582	AQ9421480	FRTR 1 1/4 05/25/34	Government	Aa2	FR	8,8	Fisso	EUR	€86,51	157.000	€136.512,05	86,00	Nominale	2,05%
FR0013410552	AX7057695	FRTR 0.1 03/01/29 I/L	Government	Aa2	FR	4,37	Fisso	EUR	€117,81	65.000	€76.621,77	115,00	Reale	1,15%
FR0013515806	BJ7361725	FRTR 0 1/2 05/25/40	Government	Aa2	FR	14,41	Fisso	EUR	€66,71	101.000	€67.557,22	71,00	Nominale	1,01%
FR0013519253	BK0496913	FRTR 0.1 03/01/26	Government	Aa2	FR	1,39	Fisso	EUR	€118,41	7.000	€8.293,48	113,00	Reale	0,12%
FR0014001N38	BN5634736	FRTR 0.1 07/25/31	Government	Aa2	FR	6,74	Fisso	EUR	€115,34	43.000	€49.604,10	120,00	Reale	0,74%
IE00BDHDP44	AQ5958584	IRISH 0,9% 05/28	Government	Aa3	IE	3,49	Fisso	EUR	€96,07	13.000	€12.532,68	101,00	Nominale	0,19%
IT0003934657	EF1307950	BTP 4% 01/02/37	Government	Baa3	IT	9,53	Fisso	EUR	€105,14	25.000	€26.448,04	98,00	Nominale	0,40%
IT0004735152	EI7048099	BTPS 3,1% 09/26 I/L	Government	Baa3	IT	1,89	Fisso	EUR	€138,90	43.000	€59.802,39	138,00	Reale	0,90%
IT0005127086	UV6569569	BTPS 2 12/01/25	Government	Baa3	IT	1,12	Fisso	EUR	€99,43	388.000	€388.353,86	98,00	Nominale	5,82%
IT0005138828	QJ1237321	BTPS 1,25% 09/32 I/L	Government	Baa3	IT	7,49	Fisso	EUR	€125,12	22.000	€27.540,90	115,00	Reale	0,41%
IT0005240350	AM2016153	BTPS 2,45% 09/01/33	Government	Baa3	IT	7,77	Fisso	EUR	€94,29	163.000	€154.012,62	90,00	Nominale	2,31%
IT0005246134	AM7652176	BTPS 1,3% 05/28 I/L	Government	Baa3	IT	3,49	Fisso	EUR	€126,72	28.000	€35.653,85	119,00	Reale	0,53%

Portafoglio n. 676057

Strumenti in portafoglio

Obbligazioni

ISIN	Ticker Bloomberg	Denominazione	Tipo emittente	Rating Moody's	Paese	Duration	Tipo cedola	Divisa	Prezzo in Euro	Quantity	Controvalore	Costo di carico	Tipo tasso	Peso PTF
IT0005383309	ZR3437988	BTPS 1.35 04/01/30	Government	Baa3	IT	5,16	Fisso	EUR	€92,70	140.000	€130.719,83	90,00	Nominale	1,96%
IT0005387052	ZR9250799	BTPS 0,4 05/15/30 I/L	Government	Baa3	IT	5,48	Fisso	EUR	€116,50	37.000	€43.173,30	111,00	Reale	0,65%
IT0005398406	ZP5131328	BTPS 2.45 09/01/50	Government	Baa3	IT	17,44	Fisso	EUR	€75,89	84.000	€63.912,46	82,00	Nominale	0,96%
IT0005415416	BK1983232	BTPS 0.65 05/15/26 II	Government	Baa3	IT	1,59	Fisso	EUR	€118,82	35.000	€41.688,04	114,00	Reale	0,63%
IT0005445306	BP4786771	BTPS 0 1/2 07/15/28	Government	Baa3	IT	3,66	Fisso	EUR	€92,73	100.000	€92.834,61	89,00	Nominale	1,39%
IT0005482994	BU0694846	BTPS 0.1 05/15/33	Government	Baa3	IT	8,45	Fisso	EUR	€103,76	55.000	€57.093,73	99,00	Reale	0,86%
IT0005530032	ZM3378175	BTPS 4.45 09/01/43	Government	Baa3	IT	12,66	Fisso	EUR	€107,01	46.000	€49.388,58	101,00	Nominale	0,74%
IT0005607459	YW6067964	BOTS 0 01/31/25	Government	Baa3	IT	0,33	Zero coupon	EUR	€98,95	883.000	€873.737,33	99,00	Nominale	13,10%
IT0005607970	YW6730231	BTPS 3.85 02/01/35	Government	Baa3	IT	8,32	Fisso	EUR	€103,63	130.000	€135.535,03	103,00	Nominale	2,03%
NL0015001AM2	ZM6605228	NETHER 2 1/2 07/15/3	Government	Aaa	NL	7,77	Fisso	EUR	€101,12	122.000	€124.009,82	98,00	Nominale	1,86%
NL0015614579	ZO5449301	NETHER 0 01/15/52	Government	Aaa	NL	26,59	Fisso	EUR	€49,51	77.000	€38.122,75	58,00	Nominale	0,57%
PTOTETOE0012	JV6513743	PGB 2,875% 07/26	Government	A3	PT	1,74	Fisso	EUR	€101,33	75.000	€76.419,93	100,00	Nominale	1,15%
PTOTEXOEO024	AW5986319	PGB 1,95% 06/29	Government	A3	PT	4,42	Fisso	EUR	€99,06	27.000	€26.901,08	104,00	Nominale	0,40%
Totale										-	€4.674.361,91			70,08%

Fondi

ISIN	Ticker Bloomberg	Denominazione	Tipologia	Paese	Divisa	Prezzo in Euro	Quantità	Controvalore	Costo di carico	Peso PTF
LU0335977202	SPIEURO LX	EF EQUITY EURO CL Z LTE	PC az non heg	LU	EUR	€ 221,39	6.464,62	€ 1.431.201,11	170,00	21,46%
LU1559924763	EUUEQUX LX	EF EQ USA - X	PC az non heg	LU	EUR	€ 255,36	1.467,8	€ 374.818,42	193,00	5,62%
Totale								€ 1.806.019,53		27,08%

Liquidità

Divisa	Valore PTF in divisa	Cambio	Controvalore	Peso PTF
EUR	189.377,75	1,00	€ 189.377,75	2,84%
Totale non euro				
Totale			€ 189.377,75	2,84%

Portafoglio n. 676057

Disclaimer

Copyright 2024, Standard & Poor's Financial Services LLC. Reproduction of S&P Credit Ratings in any form is prohibited except with the prior written permission of Standard & Poor's Financial Services LLC (together with its affiliates, S&P). S&P does not guarantee the accuracy, completeness, timeliness or availability of any information, including ratings, and is not responsible for any errors or omissions (negligent or otherwise), regardless of the cause, or for the results obtained from the use of ratings. S&P GIVES NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, INCLUDING, BUT NOT LIMITED TO, ANY WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE. S&P shall not be liable for any direct, indirect, incidental, exemplary, compensatory, punitive, special or consequential damages, costs, expenses, legal fees, or losses (including lost income or profits and opportunity costs or losses caused by negligence) in connection with any use of Ratings. S&P's ratings are statements of opinions and are not statements of fact or recommendations to purchase, hold or sell securities. They do not address the market value of securities or the suitability of securities for investment purposes, and should not be relied on as investment advice.

I dati e le informazioni contenuti nell'ambito della presente comunicazione hanno carattere provvisorio e non costituiscono - ad ogni effetto - rendiconto del servizio di gestione di portafogli ai sensi dell'art. 62 Delibera Consob 11522/98 e successive modificazioni ed integrazioni.