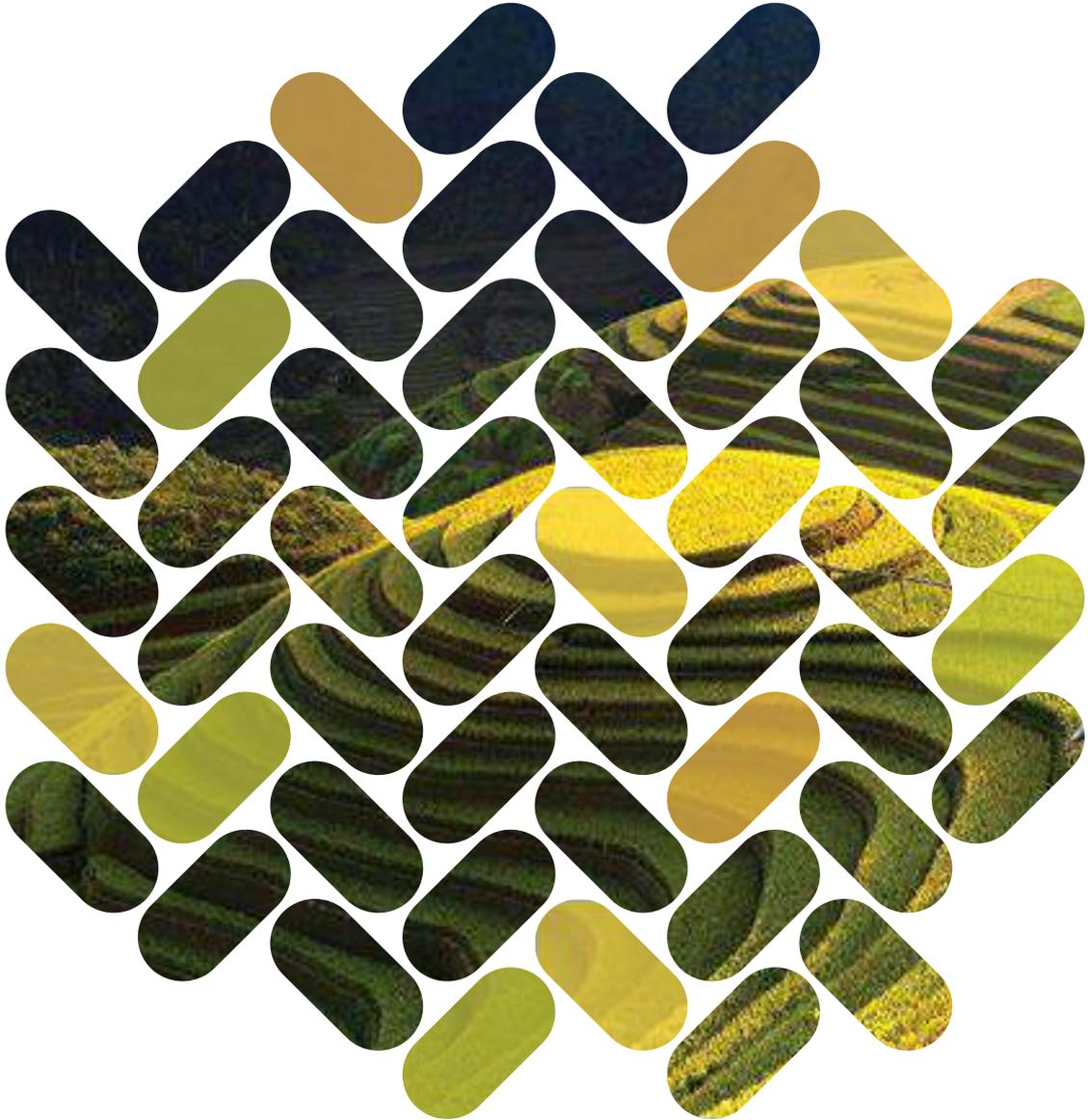


FINECO

ASSET
MANAGEMENT



CORE Series

CORE FAM Park

Report mensile di gestione

SETTEMBRE 2024

CORE FAM Park

CORE Series

Report Mensile Di Gestione: Settembre 2024

FINECO

ASSET
MANAGEMENT

Caratteristiche Del Fondo

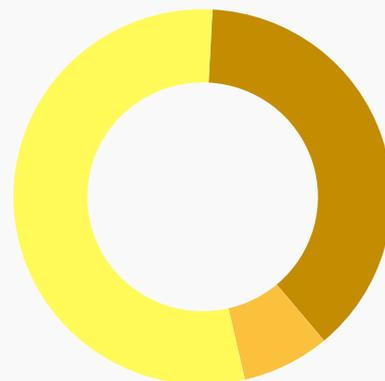
ISIN	LU0575777387
AUM	490,855,256.00€
FAMIGLIA	CORE SERIES
TIPOLOGIA	FONDO DI FONDI
GESTORE	TEAM FUNDS SOLUTIONS DI FINECO ASSET MANAGEMENT
INCEPTION DATE	02/01/2018
DATI AGGIORNATI AL	30/09/2024
MANAGEMENT FEE	0.15%

Descrizione Del Fondo

Fondo di fondi che assume l'obiettivo di offrire un apprezzamento del capitale in linea con i tassi del mercato monetario. Il fondo investe in strumenti del mercato monetario e in titoli di debito caratterizzati da elevato merito di credito.

Building Blocks

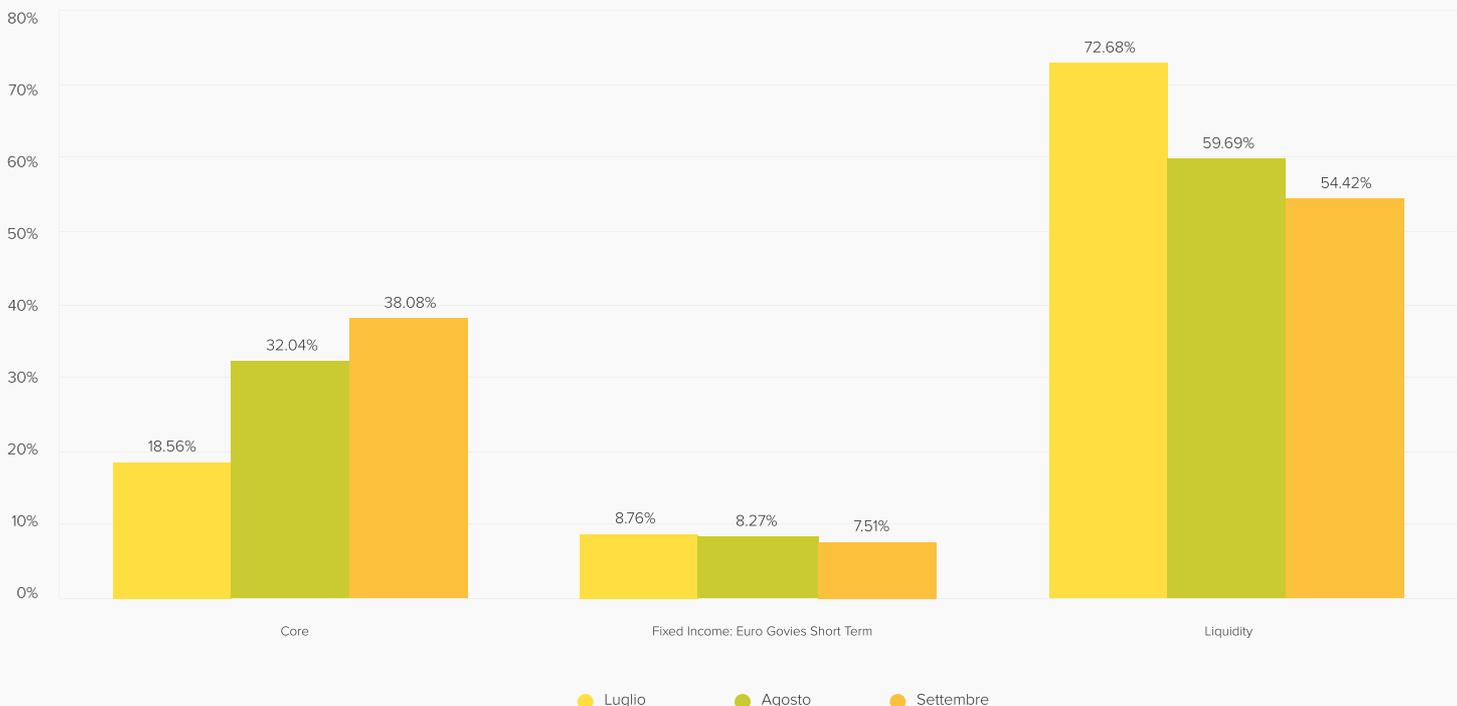
ASSET	Peso %
Core	38.08%
Fixed Income: Euro Govies Short Term	7.51%
Liquidity	54.42%



Top 10 Portfolio Holdings

ASSET	Peso %
ENHANCED ULTRA SH TERM BD SRI FAM FD - J	18.70%
ULTRA SHORT TERM BOND SRI FAM FUND - J D	18.11%
FINECO AM ST FI OPP FD J ACC	12.22%
FINECO AM ST FI OPP FD II J	12.17%
BNPP ENHNCD BD 6M I PLUS CAP	9.79%
FINECO AM BBG EUR TRSY 1-3Y IDX J ACC	7.51%
CANDRIAM MONEY MKT EURO V CAP	4.56%
Fineco AM MSCI Eur IG SRI 1-3Y Cp A Acc	2.49%
GROUPAMA ENTREPRIS-I	1.59%
BNPP SUS ENH BD 12M I PLS CAP	0.95%

Confronto Mese Su Mese

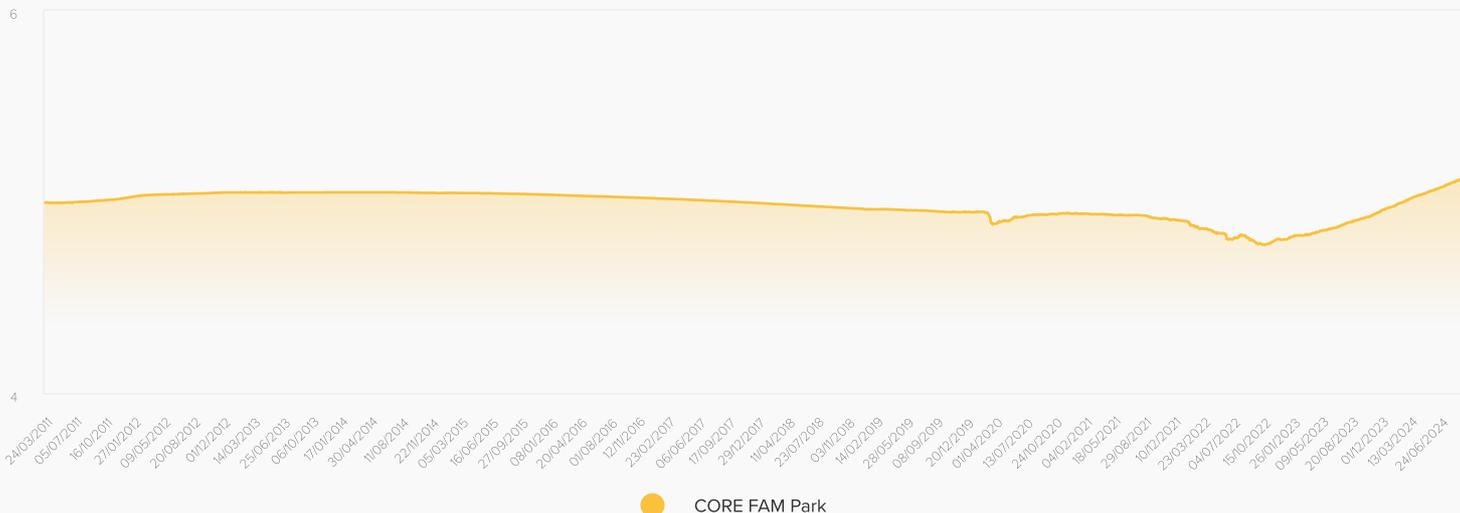


Performance

Dati aggiornati al 30/09/2024

YTD	1m	3m	6m	12m	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	S.I.
3.20%	0.27%	1.04%	2.03%	4.42%	0.42%	0.58%	0.02%	-0.08%	-0.18%	-0.36%	-0.50%	-0.62%	-0.32%	-0.16%	-0.71%	-2.02%	3.45%	2.62%

NAV



Commento

Nel mese FAM Park ha registrato una performance positiva di circa 27 pb al netto delle commissioni. Amundi Enhanced Ultra Short Term Fund ha ottenuto un rendimento di 35 pb. BNP Enhanced Bond 6m ha guadagnato 45 pb nel periodo considerato, mentre BNP 6m è avanzato di 31 pb e BNP Sustainable Enhanced 12m ha reso 44 pb. Candriam Money Market Fund, Bloomberg Passive 1-3y Fund e Amundi Ultra Short Term Bond Fund hanno reso rispettivamente 28 pb, 61 pb e 34 pb. Groupama Money Market Fund 6m ha guadagnato 29 pb e infine La Francaise Money Market Fund ha generato 29 pb. Il fondo ha ridotto la duration nel corso del mese in quanto il mercato ha cominciato a scontare ulteriori tagli dei tassi da parte della BCE. Il rischio viene attentamente monitorato al fine di mantenere la volatilità del fondo su livelli molto bassi

e sovraperformare al contempo il benchmark in modo regolare e graduale. Le modifiche apportate al fondo durante il mese hanno riguardato principalmente la riduzione della duration mediante la vendita di futures, al fine di rendere il portafoglio meno sensibile a un aumento dei tassi d'interesse. Altre operazioni significative hanno interessato i Treasury a 1-3 anni e le obbligazioni corporate con copertura della duration a seguito della scadenza di singoli titoli in portafoglio. Nel corso del mese è stato effettuato un investimento in Fineco AM Short Term Fixed Income Opportunities con l'obiettivo di assumere un'esposizione al segmento a 0-1 anno dell'indice Euro Agg.