



# onemarkets Fund

Questa versione rappresenta una traduzione.  
L'oggetto della verifica da parte del revisore è stata solo la versione inglese,  
anch'essa autorevole.

## Relazione annuale, comprensiva del bilancio d'esercizio certificato 2023

Fondo di investimento multicomparto di diritto lussemburghese "Société d'Investissement à Capital Variable" (SICAV)

Società di gestione: Structured Invest S.A.

R.C.S. Luxembourg B 271 238

Esercizio compreso tra il 15 settembre 2022 (data di costituzione) e il 30 giugno 2023

**Structured Invest S.A.**



# onemarkets Fund

---

## Indice

Informazioni importanti	3
Gestione e amministrazione	4
Relazione del Consiglio di Amministrazione	10
Relazione del Réviseur d'entreprises agréée	24
Prospetto integrale attività nette al 30/06/23	28
Conto economico integrato e prospetto delle variazioni per l'esercizio concluso il 30/06/23	29
Comparti:	30
onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)	30
onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	45
onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	67
onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)	74
onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	81
onemarkets Fund - onemarkets Pimco Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	90
onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	104
onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	108
onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	112
onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	126
onemarkets Fund - onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	130
onemarkets Fund - onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	134
onemarkets Fund - onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	138
onemarkets Fund - onemarkets Global Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	142
onemarkets Fund - onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	146
onemarkets Fund - onemarkets Multi-Asset Value Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	150
Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati	154
Altre note al bilancio	187
Altre informazioni (non certificate)	194

Le sottoscrizioni sono valide soltanto se effettuate sulla base del Prospetto informativo in vigore integrato dall'ultima relazione annuale.

# onemarkets Fund

---

## Informazioni importanti

Non è possibile effettuare sottoscrizioni sulla sola base della presente relazione annuale. Le azioni devono essere acquistate sulla base del prospetto, del Key Information Document (KID), dei regolamenti di gestione e dei regolamenti specifici del Fondo.

Il Key Information Document (KID), il prospetto, le relazioni annuali, inclusi i bilanci certificati (ove applicabile) e le relazioni semestrali non certificate sono a disposizione, gratuitamente, presso la sede legale della Società di gestione, la banca depositaria e tutti gli agenti incaricati del pagamento del Fondo, ai sensi del diritto lussemburghese e delle leggi di tutte le giurisdizioni pertinenti.

# onemarkets Fund

---

## Gestione e amministrazione

### Sede legale

8-10, rue Jean Monnet  
L-2180 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

### Consiglio di Amministrazione della SICAV

#### *Presidente:*

Claudia Vacanti  
UniCredit S.p.A.  
Piazza Gae Aulenti, 1  
I-20154 Milano  
Italia

#### *Amministratori:*

Christian Moritz Voit  
UniCredit Bank AG  
Arabellastraße 12  
D-81925 Monaco di Baviera  
Germania

Flavio Bonomo  
UniCredit S.p.A.  
Piazza Gae Aulenti, 1  
I-20154 Milano  
Italia

Manuela D'Onofrio  
UniCredit S.p.A.  
Piazza Gae Aulenti, 1  
I-20154 Milano  
Italia

Stefan Martin Lieser (fino al 30 giugno 2023)  
Structured Invest S.A.  
8-10, rue Jean Monnet  
L-2180 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

Thomas Friedrich  
UniCredit Bank AG  
Arabellastraße 12  
D-81925 Monaco di Baviera  
Germania

### Società di gestione

Structured Invest S.A.  
8-10, rue Jean Monnet  
L- 2180 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

# onemarkets Fund

---

## **Consiglio di Amministrazione di Structured Invest S.A**

*Presidente:*

Christian Moritz Voit  
UniCredit Bank  
AG Arabellastraße 12  
D-81925 Monaco di Baviera  
Germania

*Amministratori:*

Stefan Martin Lieser (fino al 30 giugno 2023)  
Structured Invest S.A.  
8-10, rue Jean Monnet  
L-2180 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

Sandro Boscolo Anzoletti (fino al 30 aprile 2023)  
UniCredit Bank AG  
Arabellastraße 12  
D-81925 Monaco di Baviera  
Germania

Dr. Joachim Beckert  
UniCredit International Bank (Luxembourg) S.A.  
8-10, rue Jean Monnet  
L-2180 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

Alexander Walter Tumminelli (dal 26 aprile 2023)  
UniCredit Bank AG  
Arabellastraße 12  
D-81925 Monaco di Baviera  
Germania

## **Amministratori delegati di Structured Invest S.A**

Stefan Martin Lieser  
Rüdiger Herres

**Banca depositaria, Agente per i trasferimenti, Agente per l'amministrazione centrale e Agente per i pagamenti in Lussemburgo**

CACEIS Bank, Luxembourg Branch  
5, Allée Scheffer  
L-2520 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

Sito Web: [www.structuredinvest.lu](http://www.structuredinvest.lu)

E-Mail: [fonds@unicredit.lu](mailto:fonds@unicredit.lu)

# onemarkets Fund

---

## Distributori e subdistributori

Allfunds Bank S.A.U.  
Calle de Los Padres  
Dominicos 7  
Madrid  
Spagna

UniCredit Bank AG  
Arabellastraße 12  
D-81325 Monaco di Baviera  
Germania

UniCredit Bank Austria AG  
Schottengasse 6-8  
1010 Vienna  
Austria

Schoellerbank AG  
Renngasse 3  
1010 Vienna  
Austria

## Gestori degli investimenti e Subgestore degli investimenti

onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund  
(lanciato il 5 ottobre 2022)

Amundi SGR S.p.A.  
Via Cernaia, 8-10  
20121 Milano  
Italia

onemarkets Amundi Flexible Income Fund  
(lanciato il 28 settembre 2022)

Amundi Deutschland GmbH  
Arnulfstraße 124-126  
D-80636 Monaco di Baviera  
Germania

onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund  
(lanciato il 28 settembre 2022)

Amundi Ireland Ltd  
1, George's Quay Plaza  
George's Quay  
Dublino 2  
Irlanda

onemarkets Fidelity World Equity Income Fund  
(lanciato il 29 settembre 2022)

FIL (Luxembourg) S.A.  
2a Rue Albert Borschette  
BP 2174  
L-1021 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

Subgestore degli investimenti:  
FIL Investments International  
Beech Gate  
Millfield Lane  
Lower Kingswood  
Tadworth  
Surrey, KT20 6RP  
Regno Unito

# onemarkets Fund

---

## Gestori degli investimenti e Subgestore degli investimenti

onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund  
(lanciato il 30 settembre 2022)

BlackRock Investment Management (UK) Limited  
12 Throgmorton Avenue  
Londra, EC2N 2DL  
Regno Unito

*Subgestore degli investimenti:*

BlackRock Investment Management (LLC)  
1 University Square Drive  
Princeton  
New Jersey 08540 Stati Uniti d'America

onemarkets Pimco Global Balanced Allocation Fund  
(lanciato l'11 ottobre 2022)

PIMCO Europe GmbH  
Seidlstraße 24-24 A  
D-80335 Monaco di Baviera  
Germania

*Subgestori degli investimenti:*

Pacific Investment Management Company LLC  
650 Newport Center Drive  
Newport Beach  
92660 CA  
Stati Uniti d'America

PIMCO Europe Ltd  
11 Baker Street  
Londra, W1U 3AH  
Regno Unito

onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

PIMCO Europe GmbH  
Seidlstraße 24-24 A  
D-80335 Monaco di Baviera  
Germania

*Subgestori degli investimenti:*

Pacific Investment Management Company LLC  
650 Newport Center Drive  
Newport Beach  
92660 CA  
Stati Uniti d'America

PIMCO Europe Ltd  
11 Baker Street  
Londra, W1U 3AH  
Regno Unito

# onemarkets Fund

---

## Gestori degli investimenti e Subgestore degli investimenti

onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

PIMCO Europe GmbH  
Seidlstraße 24-24 A  
D-80335 Monaco di Baviera  
Germania

*Subgestori degli investimenti:*  
Pacific Investment Management Company LLC  
650 Newport Center Drive  
Newport Beach  
92660 CA  
Stati Uniti d'America

PIMCO Europe Ltd  
11 Baker Street  
Londra, W1U 3AH  
Regno Unito

onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund  
(lanciato il 30 settembre 2022)

J.P. Morgan Asset Management (UK) Limited  
25 Bank Street, Canary Wharf  
Londra, E14 5JP  
Regno Unito

*Subgestore degli investimenti:*  
J.P. Morgan Investment Management Inc.  
245 Park Avenue  
New York  
NY 10167  
Stati Uniti d'America

onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

J.P. Morgan Asset Management (UK) Limited  
25 Bank Street, Canary Wharf  
Londra, E14 5JP  
Regno Unito

*Subgestore degli investimenti:*  
J.P. Morgan Investment Management Inc.  
245 Park Avenue  
New York  
NY 10167  
Stati Uniti d'America

onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

Allianz Global Investors GmbH  
Bockenheimer Landstrasse 42-44  
60323 Francoforte sul Meno  
Germania

onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

Allianz Global Investors GmbH  
Bockenheimer Landstrasse 42-44  
60323 Francoforte sul Meno  
Germania

onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

Pictet Asset Management SA  
Route des Accacias 60  
1211 Ginevra 73  
Svizzera

onemarkets Global Multibrand Selection Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

UniCredit International Bank (Luxembourg) S.A.  
8-10, rue Jean Monnet  
L-2180 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo



# onemarkets Fund

---

## **Gestori degli investimenti e Subgestore degli investimenti**

onemarkets Balanced Eastern Europe Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

ZB Invest Ltd.  
Samoborska cesta 145  
Zagabria, 10090  
Croazia

onemarkets Multi-Asset Value Fund  
(lanciato il 30 giugno 2023)

Plenisfer Investments SGR SpA  
*Domicilio:*  
via Niccolò Macchiavelli n. 4  
Trieste, 34132  
Italia

*Indirizzo sede centrale:*  
via Sant'Andrea 10/A  
Milano, 20121  
Italia

## **Revisore dei conti abilitato della Società di gestione**

KPMG Luxembourg, Société anonyme  
*Cabinet de Révision Agréé*  
39, Avenue John F.Kennedy  
L-1855 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

## **Revisore legale del Fondo**

Deloitte Audit  
*Société à responsabilité limitée*  
*Cabinet de Révision Agréé*  
20, Boulevard de Kockelscheuer  
L-1821 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

## **Consulente legale**

Clifford Chance, Lussemburgo  
10, Boulevard G.D. Charlotte  
B.P. 1147  
L-1011 Lussemburgo  
Granducato di Lussemburgo

## Relazione del Consiglio di Amministrazione

### Relazione della Società di gestione al 30 giugno 2023

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund

#### Performance del portafoglio

Nel complesso, il portafoglio ha registrato un rendimento negativo dal lancio, con performance negative nelle nostre posizioni macro direzionali, nelle posizioni Satellite di valore relativo e nelle coperture (Hedges).

Il nostro pillar direzionale macro ha sottoperformato ed è stato il maggior detrattore, ovvero la componente che ha pesato maggiormente in negativo. La sottoperformance è dovuta principalmente alle nostre posizioni lunghe sulle obbligazioni statunitensi. I timori di un'inflazione core persistente hanno portato a tassi più alti del previsto più a lungo del previsto, penalizzando la nostra esposizione lunga ai titoli di Stato statunitensi. I dati sull'inflazione nel Regno Unito, generalmente peggiori delle attese, hanno spinto i rendimenti dei Gilt ai massimi registrati nel terzo trimestre 2022, all'apice della crisi LDI del Regno Unito, con effetti sulle nostre posizioni nelle obbligazioni del Paese. Anche le posizioni lunghe sul dollaro USA hanno fortemente penalizzato la performance generale a causa del deprezzamento della valuta. Il calo dei prezzi delle materie prime e dell'oro ha causato la sottoperformance delle nostre posizioni lunghe su questi asset. Sul fronte positivo, le nostre posizioni lunghe sull'azionario europeo, statunitense e giapponese hanno favorito la performance, al pari dell'esposizione lunga sull'investment grade europeo a fronte della contrazione degli spread.

Come era prevedibile, dopo l'apprezzamento della maggior parte dei mercati azionari e obbligazionari, nel periodo in esame le nostre coperture hanno sottoperformato, penalizzando il risultato complessivo. Per proteggere il portafoglio da un'eventuale correzione del mercato azionario e/o obbligazionario (che inciderebbe sulla performance complessiva del Fondo, data la nostra esposizione lunga su entrambe le asset class), deteniamo opzioni put su vari mercati azionari e obbligazionari. Alla luce degli eventi, queste opzioni put hanno perso valore e hanno generato alcune perdite per il portafoglio. La sottoperformance maggiore è riconducibile alle coperture sugli indici azionari europei; anche le coperture sul credito investment grade e high yield (eravamo coperti da un ampliamento degli spread creditizi) hanno causato alcune perdite.

La performance negativa delle strategie di valore relativo, con rendimenti positivi dal nostro sottopilastro Spread, è stata ampiamente compensata dalle perdite sui sottopilastri Azioni, Tassi di interesse, Materie prime, Inflazione e volatilità e Quantitativo, mentre il sottopilastro Cambi è rimasto invariato.

Nel sottopilastro Spread abbiamo preso buone decisioni tattiche sui tempi di uscita e ingresso sul mercato creditizio e, nonostante un marzo difficile, questo sottopilastro ha registrato la performance migliore nel periodo in esame, con guadagni in varie strategie, inclusi i mercati sovrani periferici in euro, finanziari IG, ciclici e difensivi.

Nel sottopilastro Tassi di interesse, abbiamo gestito in maniera dinamica la nostra esposizione, sia lunga che corta, in varie fasi. Tuttavia, nonostante un primo trimestre positivo, nel secondo trimestre questo sottopilastro ha perso terreno a causa dell'aumento dei rendimenti e dell'appiattimento della curva nel Regno Unito, che ha in parte influenzato alcune delle nostre operazioni sulla curva, dove eravamo posizionati per un certo irripidimento. La performance del nostro sottopilastro Materie prime, Inflazione e volatilità è rimasta invariata a causa di diversi fattori: eravamo posizionati per un aumento della volatilità in varie asset class, che tuttavia nel secondo trimestre è diminuita; una generale debolezza dei prezzi delle materie prime e alcune perdite nelle nostre posizioni sulla volatilità dei cambi a lungo termine. Sul fronte Quantitativo alcune delle nostre strategie, come il modello azionario, che aveva una posizione lunga negli Stati Uniti e in Giappone, hanno ottenuto buoni risultati nel primo semestre, ma nel complesso questo sottopilastro ha contribuito negativamente, con i rendimenti peggiori nel modello Cross asset a causa della posizione lunga sui titoli di Stati USA e in alcuni dei modelli Trend Following e Currency, penalizzati dalla debolezza dello yen giapponese e della corona norvegese.

Sul fronte negativo, il nostro sottopilastro Azioni ha subito alcune perdite a causa dello scarso rendimento di alcune posizioni settoriali: a marzo avevamo una posizione lunga sulle banche europee, a fronte di una posizione corta sull'indice EURO STOXX 50, in base al principio che tassi d'interessi più alti in genere avvantaggiano il settore bancario; avevamo anche una posizione lunga su titoli value in euro, a fronte di una posizione lunga sull'indice EURO STOXX 50, e nel corso del mese anche i settori value hanno sottoperformato; tra le strategie che hanno sottoperformato, anche il nostro paniere ESG di azioni europee considerate leader sotto il profilo ESG, che ha relativamente sottoperformato l'EURO STOXX 50.

# onemarkets Fund

---

## **Performance delle classi di azioni**

Le classi di azioni di onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund hanno conseguito i seguenti rendimenti:

- A (ISIN: LU2503833399) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: -7,79%
- C (ISIN: LU2503840923) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: -7,97%
- M (ISIN: LU2503840840) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: -7,77%
- MD (ISIN: LU2503840766) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: -7,73%
- U (ISIN: LU2503840337) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: -8,29%
- E (ISIN: LU2503840097) per il periodo dal 5 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: -7,28%
- O (ISIN: LU2503840683) per il periodo dal 6 ottobre al 7 giugno 2023: -5,98%
- OD (ISIN: LU2503840501) per il periodo dal 6 ottobre al 7 giugno 2023: -5,99%

## **Obblighi di informativa ai sensi dell'SFDR**

L'informativa obbligatoria periodica ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088 per il Comparto si trova nella sezione Altre informazioni (non certificate), al punto 5.

# onemarkets Fund

---

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund

## Analisi della performance

Rendimento positivo per il Fondo dalla data di lancio al 30 giugno 2023 (classe E +2,19%, al netto delle commissioni di gestione, prima delle imposte). Il principale contributo positivo è stato apportato dall'azionario, guidato dall'esposizione agli Stati Uniti, la scelta principale, seguiti da Europa e Giappone; il contributo dei mercati emergenti è stato negativo a causa della debolezza della Cina. A livello settoriale, il maggior contributo positivo è stato offerto dalla tecnologia e dai consumi discrezionali, seguiti dai servizi di comunicazione e dai finanziari, mentre l'immobiliare, il farmaceutico e i consumi non ciclici hanno perso terreno.

Contributo negativo dell'obbligazionario a causa delle posizioni lunghe sui tassi core (soprattutto quelli statunitensi) e di strategie di irripidimento della curva dei rendimenti USA; queste perdite sono state in parte compensate dall'esposizione al credito investment grade (soprattutto USA, tramite l'indice Credit Default Swap (CDX)), al credito high yield (soprattutto europeo) e al debito sovrano emergente (soprattutto in valuta forte); positive anche l'esposizione ai titoli di Stato europei, soprattutto periferici (Italia), e le posizioni lunghe sull'inflazione europea.

Contributo leggermente negativo delle materie prime a causa della debolezza dell'indice generale (via ETC) e, in misura minore, dei metalli industriali, mentre la posizione sull'oro è stata leggermente positiva. Le strategie valutarie sono state leggermente negative per effetto delle posizioni lunghe su dollaro USA e yen.

Tra le strategie di copertura, le coperture sui tassi statunitensi sono state positive, quelle su azioni USA e credito high yield europeo sono risultate negative.

## Attività e posizionamento del portafoglio

Nel quarto trimestre 2022 il portafoglio è stato gradualmente spostato verso l'allocazione target, caratterizzata da un posizionamento bilanciato. All'inizio del 2023 abbiamo assunto una posizione difensiva su aspettative di recessione degli utili e rallentamento economico negli Stati Uniti.

Azionario: a gennaio, dopo il rally, abbiamo rafforzato le protezioni (put su S&P 500 e Eurostoxx 50), finanziate dalla liquidazione di posizioni sull'indice S&P 500; abbiamo aumentato l'esposizione alla Cina. A inizio febbraio, dopo il rally, abbiamo ridotto l'azionario vendendo (tramite futures) Europa, Stati Uniti e mercati emergenti (indice globale). A inizio marzo abbiamo effettuato alcuni acquisti tattici tramite futures sugli indici UEM e USA, in un contesto di mercato molto debole; poi, alla vigilia della crisi della Silicon Valley Bank, abbiamo preso profitto riducendo gli Stati Uniti; abbiamo rafforzato l'esposizione alla Cina. Dopo il calo seguito al fallimento della Silicon Valley Bank, abbiamo aumentato leggermente l'esposizione, tramite opzioni, chiudendo le opzioni put sull'indice S&P 500 e aprendo una posizione sul Nasdaq, alla luce del calo dei rendimenti. La selezione è stata incentrata su temi difensivi (servizi pubblici, telecomunicazioni, sanità, beni di prima necessità) a scapito di quelli ciclici (abbiamo ridotto beni di consumo discrezionali, finanziari, industriali). La posizione sui titoli immobiliari è stata costruita gradualmente. Materie prime, posizione principale sull'oro.

Obbligazioni: a gennaio la duration USA è stata incrementata; abbiamo aperto una posizione corta sui titoli a 10 anni in Giappone (la Bank of Japan prevedeva di essere meno accomodante); le coperture sui tassi USA sono state incrementate in vista dei dati sull'inflazione di febbraio; a marzo abbiamo rafforzato l'irripidimento negli Stati Uniti (2-10 anni), nella convinzione che il punto di svolta della Fed fosse più vicino. L'inflazione è aumentata nell'Eurozona e nel Regno Unito (a causa del calo eccessivo delle aspettative), mentre è leggermente diminuita negli Stati Uniti. Credito: abbiamo mantenuto la preferenza per l'Europa; negli Stati Uniti ci siamo concentrati sull'IG e a febbraio abbiamo aperto una posizione sull'HY tramite Credit Default Swap. A marzo abbiamo aumentato l'esposizione sul debito dei mercati emergenti (Credit Default Swap sull'indice EMBI). Cambi: abbiamo ridotto la posizione lunga su USD vs. EUR, confermato quella su JPY vs. USD; i cambi dei mercati emergenti sono leggermente aumentati. Abbiamo mantenuto le coperture su azioni, tassi USA e credito HY.

Nel secondo trimestre l'allocazione è stata resa gradualmente più difensiva, con un'intensificazione a giugno, quando abbiamo sfruttato il rally, alla luce di maggiori rischi di recessione negli Stati Uniti e di segnali di deterioramento degli utili aziendali. Questo posizionamento difensivo è stato ottenuto con una significativa riduzione dell'esposizione azionaria, che alla fine del periodo era al minimo dell'anno, e, in misura minore, del rischio di credito, mentre la duration è stata aumentata.

La riduzione dell'esposizione azionaria, tramite futures su indici, ha riguardato prevalentemente gli Stati Uniti (prima scelta di allocazione) seguita da Europa e Paesi emergenti (mentre la Cina è stata ridotta dopo i deludenti dati macro); per contro, l'esposizione al Giappone è aumentata, dato il momentum favorevole. L'allocazione settoriale è rimasta incentrata su temi difensivi (servizi pubblici, sanità, ma anche la tecnologia, tramite posizioni lunghe sul Nasdaq) e meno esposta ai ciclici (energia, finanziari e industriali; il sottopeso sui beni di consumo discrezionali negli Stati Uniti è stato rafforzato a giugno). Esposizione ad azioni di beni reali: infrastrutture (gestori di strade a pedaggio, aeroporti, attività alberghiere); energia

# onemarkets Fund

(focus su aziende con una chiara visione su energie rinnovabili, combustibili alternativi o stoccaggio dell'energia), immobili (centri di dati, logistica, edilizia residenziale), materiali (società minerarie, costruzione di infrastrutture, produzione di gas)

Tassi: a giugno abbiamo preso in parte profitto sulle protezioni sui tassi USA, con un conseguente aumento della duration. Abbiamo confermato la strategia di irripidimento negli Stati Uniti sui titoli a 2-10 anni, auspicando una normalizzazione della curva dei tassi d'interesse (ora invertita), e in Canada. Abbiamo anche mantenuto la posizione corta sui tassi decennali in Giappone e la preferenza per l'Italia. Strategie di valore relativo: a maggio abbiamo aperto una posizione lunga sul Regno Unito (dopo che i tassi erano aumentati drasticamente a causa di dati sull'inflazione superiori al consensus) rispetto agli Stati Uniti e una posizione lunga sui Bund rispetto agli Stati Uniti (i rendimenti dei Treasury erano scesi in modo significativo). La posizione lunga sull'inflazione è stata confermata nel Regno Unito e nell'Eurozona e, in misura minore, negli Stati Uniti, a fini di copertura e diversificazione.

Credito: ad aprile abbiamo ridotto i rischi diminuendo l'esposizione all'HY europeo e all'investment grade USA (in entrambi i casi tramite Credit Default Swap). A giugno abbiamo implementato una strategia di valore relativo con posizione lunga su ETF iShares Euro Corporate vs. iTraxx Main (lo spread tra il mercato a pronti e il mercato sintetico si è ristretto troppo a vantaggio del Credit Default Swap). Il rischio (spread duration) è allocato principalmente al segmento IG, soprattutto in Europa (valutazioni più interessanti), mentre restiamo cauti verso il segmento HY (a causa dell'elevata sensibilità al ciclo). La selezione a livello di società resta difensiva, con focus su imprese di qualità.

Valute: nel periodo in esame abbiamo ridotto la posizione lunga sul dollaro rispetto all'euro (la Federal Reserve dovrebbe essere vicina al picco del ciclo di rialzi) e abbiamo confermato la posizione lunga sullo yen rispetto al dollaro; a maggio abbiamo ridotto le valute cicliche (Australia, Nuova Zelanda) a favore dello yen (difensivo) e dell'euro. A giugno la posizione lunga sul dollaro rispetto all'euro è stata nuovamente aumentata; nell'area emergente, lo yuan cinese è stato ridotto rispetto alle valute di Taiwan e India.

Materie prime: posizione principale sull'oro.

Manteniamo protezioni su azionari, tassi e credito HY.

## **Performance delle classi di azioni**

Le classi di azioni onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund hanno conseguito i seguenti rendimenti\*:

- A (ISIN: LU2503839750) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,39%
- AD (ISIN: LU2503839677) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,39%
- C (ISIN: LU2503839321) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,19%
- CD (ISIN: LU2503839248) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,18%
- M (ISIN: LU2503839164) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,45%
- MD (ISIN: LU2503839081) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,43%
- O (ISIN: LU2503838943) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,71%
- OD (ISIN: LU2503838869) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,40%
- U (ISIN: LU2503838786) per il periodo dal 6 dicembre 2022 al 30 giugno 2023: -0,22%
- UD (ISIN: LU2503839834) per il periodo dall'11 novembre 2022 al 30 giugno 2023: -0,05%
- E (ISIN: LU2503842622) per il periodo dal 28 settembre 2022 al 30 giugno 2023: 1,35%
- EFQD (ISIN: LU2503841657) per il periodo dal 30 novembre 2022 al 30 giugno 2023: -2,61%

\*finora solo la classe di azioni EFQD ha previsto distribuzioni, che non sono incluse nel calcolo della performance.

# onemarkets Fund

---

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund

## **Analisi dei mercati**

I mercati azionari globali hanno registrato un forte rimbalzo da ottobre 2022. Nella prima parte del 2022 i mercati sono stati deboli per effetto dei timori di recessione causati dalla combinazione tra aumento dell'inflazione e rialzo dei tassi. Tuttavia, i dati sull'inflazione si sono stabilizzati (anche se su livelli elevati). Questo, a sua volta, ha cambiato lo scenario di mercato dall'aumento al picco dei tassi di interesse, migliorando il sentiment degli investitori. Questo miglioramento, a cui si aggiungono dati economici piuttosto solidi e la resilienza degli utili, ha sostenuto il rally. Per quanto riguarda i settori, il rollover sui prezzi delle materie prime ha penalizzato i segmenti minerario ed energetico. Sul fronte positivo, considerate le aspettative di una pausa nel rialzo dei tassi da parte delle banche centrali, i settori con duration/crescita più lunghe, come quello informatico, hanno registrato buoni risultati.

## **Analisi del portafoglio**

Il portafoglio ha sovraperformato il benchmark in misura significativa, l'indice MSCI World Paris Aligned, fin dal lancio. A livello settoriale, il portafoglio ha ricevuto un contributo positivo da finanziari e beni di prima necessità. I servizi di comunicazione, invece, hanno penalizzato la performance.

I finanziari hanno subito alcune pressioni all'inizio dell'anno. Visti i problemi di insolvenza di alcune banche regionali statunitensi, a cui si aggiungono quelli di Credit Suisse qui in Europa, gli investitori sono sembrati piuttosto nervosi. La nostra preferenza per banche di qualità elevata e con una buona capitalizzazione ci ha premiato. A livello di singole azioni, la nostra partecipazione in JPMorgan ha sovraperformato dopo la pubblicazione di solidi risultati. Oltre a essere una delle banche di qualità superiore a livello mondiale, gli utili della società sono stati fortemente favoriti dal rialzo dei tassi di interesse. Anche la nostra partecipazione in BNP Paribas è risultata positiva grazie agli utili positivi.

Il portafoglio ha registrato ulteriori guadagni nei beni di prima necessità. Tra le nostre partecipazioni, Coca-Cola ha registrato una buona performance, con solidi utili nonostante i timori di rallentamento dei consumi. Da segnalare anche la buona performance della società della grande distribuzione Ahold Delhaize.

Quello informatico è stato uno dei settori migliori del mercato nel 2023. L'entusiasmo per le prospettive di crescita dell'intelligenza Artificiale (IA) ha offerto un contributo positivo, che ha favorito a cascata anche la nostra partecipazione nella società di semiconduttori Advanced Micro Devices. Buona anche la performance di Broadcom, tra i beneficiari di questo trend.

Tra i beni di consumo discrezionali, il titolo BMW ha registrato un buon andamento, sostenuto dai solidi risultati di inizio anno e dal programma di riacquisto di azioni proprie attualmente in corso.

Per contro, l'assenza di esposizione ad alcune delle principali società tecnologiche statunitensi è stata penalizzante, considerato il rally di questi titoli. Da segnalare, inoltre, la sottoperformance della società farmaceutica statunitense Pfizer. Sebbene a livello operativo l'azienda mantenga buoni risultati, la normalizzazione post-Covid e la generale riduzione delle scorte hanno causato una certa debolezza dei risultati, che ha influito negativamente sulla quotazione del titolo quest'anno.

A livello del portafoglio in generale, manteniamo un approccio bilanciato tra ciclici e difensivi. Negli ultimi mesi non abbiamo apportato alcun cambiamento significativo al posizionamento.

## **Performance delle classi di azioni**

Le classi di azioni onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund hanno conseguito i seguenti rendimenti:

- A (ISIN: LU2503843604) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 13,38%
- C (ISIN: LU2503843430) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 13,10%
- M (ISIN: LU2503843356) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 13,40%
- MD (ISIN: LU2503843273) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 13,39%
- O (ISIN: LU2503843190) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 13,73%
- OD (ISIN: LU2503842978) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 13,93%
- U (ISIN: LU2503844081) per il periodo dal 19 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 14,11%
- UD (ISIN: LU2503842895) per il periodo dal 10 novembre 2022 al 30 giugno 2023: 7,25%
- E (ISIN: LU2503842465) per il periodo dal 28 settembre 2022 al 30 giugno 2023: 16,35%

# onemarkets Fund

onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund

## Panoramica del mercato

Il quarto trimestre 2022 ha offerto agli investitori una breve tregua, dopo un anno civile altrimenti turbolento e volatile, poiché le azioni globali, misurate dall'indice MSCI World Index, hanno messo a segno un incremento del 9,7%. Si è trattato di un forte rimbalzo dai minimi di inizio autunno, supportato prevalentemente dalla resilienza degli utili aziendali, dall'inflazione inferiore alle attese negli Stati Uniti e in Europa e dall'ottimismo per la riapertura dell'economia cinese. A dicembre i mercati sono stati raffreddati dai commenti della Federal Reserve statunitense riguardo alla possibile necessità di proseguire i rialzi dei tassi e la politica monetaria restrittiva nel 2023. La performance del trimestre è stata trainata dalle azioni dei mercati sviluppati non USA e dei mercati emergenti, poiché all'indebolimento del dollaro si sono aggiunti i guadagni registrati dalle azioni non USA.

I mercati azionari hanno iniziato bene il 2023, poiché i dati sull'inflazione in calo e la pressione salariale in attenuazione hanno nuovamente spinto gli investitori a ritenere che la fine della storica campagna di rialzi dei tassi della Federal Reserve potesse essere vicina. Tuttavia, il rafforzamento dei dati economici e dell'IPC a febbraio ha pesato sul sentiment, con un'ulteriore debolezza del mercato a seguito delle turbolenze bancarie di marzo. A sorpresa, le azioni hanno terminato il trimestre in positivo, mettendo a segno un rally sulla scia della crisi bancaria, poiché la concomitanza di alcuni fattori, come il brusco calo dei tassi di interesse reali, il rapido intervento normativo a supporto del sistema bancario e dati sull'inflazione in calo ha sostenuto la fiducia degli investitori. Le azioni globali, misurate dall'indice MSCI World, hanno chiuso il trimestre con un incremento del 7,7%.

La resilienza dei mercati azionari globali è proseguita nel secondo trimestre 2023, poiché una crescita economica migliore del previsto, unita a un'inflazione dei beni relativamente contenuta nel corso del trimestre, hanno spinto gli investitori a ritenere che gli utili e i margini aziendali potessero sorprendere al rialzo nel secondo semestre 2023. La performance del mercato è stata dominata dai "magnifici sette" titoli mega-tech, che rappresentano un'ampia fetta di molti indici statunitensi, ponderati in base alla capitalizzazione di mercato. Da una prospettiva regionale, gli Stati Uniti sono stati tra i mercati con le migliori performance nel trimestre, con l'indice S&P 500 e il Nasdaq Composite, che spesso sono il riferimento della performance dei tecnologici statunitensi, che hanno messo a segno rispettivamente un incremento dell'8,7% e del 12,8%. I mercati nipponici, misurati dall'indice Nikkei (in USD), hanno reso il 9,0%, i titoli europei e dei mercati emergenti hanno registrato guadagni più modesti perché la debolezza delle azioni cinesi ha frenato la regione.

Il miglioramento delle prospettive economiche ha portato le azioni globali ad ampliare il rally a luglio 2023, con un rendimento del 3,4%, secondo l'indice MSCI World, con un deciso spostamento della leadership verso i titoli ciclici.

## Performance

La seguente performance è al lordo delle commissioni in EUR. Sebbene la valuta di riferimento sia l'euro, il Fondo è amministrato dal gestore degli investimenti in dollari statunitensi.

	Dal lancio*
onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund	17,93%
MSCI All Country World Index (ACWI)	12,29%

\*I periodi inferiori a 1 anno non sono annualizzati.

ITD I contributi primari alla performance relativa rispetto al benchmark di riferimento includono:

- Selezione di titoli nel settore sanitario.
  - A livello di Comparto, la selezione dei titoli è stata trainata principalmente dall'esposizione a società farmaceutiche e med-tech selezionate
- Selezione di titoli nel settore informatico
  - A livello di Comparto, la selezione dei titoli è stata trainata principalmente dall'esposizione a società di semiconduttori
    - L'esposizione a software e servizi è stata incrementale.
- Selezione di titoli nei beni di consumo discrezionali
  - A livello di Comparto, la selezione dei titoli è stata trainata principalmente da beni di consumo durevoli e abbigliamento.

# onemarkets Fund

---

ITD A penalizzare maggiormente la performance relativa rispetto al benchmark di riferimento nel periodo in esame sono stati:

- Esposizione al contante
- Sovrappeso e selezione di titoli nel settore dei beni di prima necessità
  - A livello di Comparto, la selezione dei titoli è stata trainata da alimentari, bevande e tabacco
- Selezione di titoli nel settore energetico
  - A livello di Comparto, la selezione dei titoli è stata trainata principalmente dall'esposizione alle energie rinnovabili

**Le cifre riportate si riferiscono alla performance passata. La performance passata non è un indicatore affidabile dei risultati presenti o futuri e non dovrebbe essere il solo fattore da considerare nella selezione di un prodotto o di una strategia.**

Data di lancio del Fondo: 30 settembre 2022. Base: rendimento al lordo delle commissioni, dividendi lordi reinvestiti in USD.

Base: rendimento al lordo delle commissioni, dividendi lordi reinvestiti in USD. La performance è indicata in USD. I rendimenti della performance dell'indice non includono commissioni di gestione, costi o spese di transazione. Gli indici non sono gestiti e non è possibile investire direttamente in un indice. I rendimenti di un investimento possono aumentare o diminuire per effetto delle oscillazioni dei cambi, se l'investimento è effettuato in una valuta diversa da quella utilizzata per il calcolo della performance passata.

*Fonti: BlackRock. I dati di attribuzione della performance si basano su rendimenti provvisori e possono differire dalle attribuzioni ufficiali. I rendimenti dei fondi quotati provengono direttamente da BlackRock.*

## **Performance delle classi di azioni**

Le classi di azioni di onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund hanno conseguito i seguenti rendimenti:

- |  |        |
|--|--------|
| • A (ISIN: LU2503843273) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 11,73% |
| • C (ISIN: LU2503836814) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 11,47% |
| • M (ISIN: LU2503836731) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 11,70% |
| • MD (ISIN: LU2503836657) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:   | 11,73% |
| • O (ISIN: LU2503836574) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 11,85% |
| • OD (ISIN: LU2503836491) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:   | 11,83% |
| • U (ISIN: LU2503836228) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 12,17% |
| • E (ISIN: LU2503835923) per il periodo dal 30 settembre 2022 al 30 giugno 2023: | 16,34% |

## **Obblighi di informativa ai sensi dell'SFDR**

L'informativa obbligatoria periodica ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088 per il Comparto si trova nella sezione Altre informazioni (non certificate), al punto 5.



# onemarkets Fund

---

onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund

## **Contesto di mercato**

Le azioni globali sono cresciute nel corso dei 12 mesi fino a giugno 2023. I mercati sono rimasti focalizzati sull'andamento dell'inflazione e sulla traiettoria implicita dei tassi d'interesse nel periodo di riferimento. Il periodo è stato caratterizzato da una forte volatilità, poiché il fallimento della Silicon Valley Bank, seguito da ulteriori turbolenze nel settore finanziario negli Stati Uniti e in Europa, ha portato a un brusco calo dei mercati nel primo semestre. Tuttavia i solidi dati economici, il rally dei titoli tecnologici e l'ottimismo verso l'intelligenza artificiale hanno spinto le azioni al rialzo nella seconda metà dell'esercizio. A livello settoriale, l'informatica (caratterizzata da una ristretta leadership di mercato) e gli industriali hanno sovraperformato il mercato mentre servizi pubblici, sanità e beni di prima necessità, relativamente difensivi, sono rimasti indietro. Debole anche la performance del settore immobiliare nel difficile contesto del mercato.

## **Performance del Fondo**

Nel periodo in esame, il Fondo ha conseguito rendimenti positivi ma ha sottoperformato il suo indice relativo. In generale, la selezione dei titoli è stata positiva. L'allocazione settoriale ha inciso negativamente sulla performance ed è risultata particolarmente debole nel settore informatico. Nel 2023, la sovraperformance di un ristretto gruppo di titoli azionari statunitensi ad alta capitalizzazione e a crescita elevata ha penalizzato i risultati.

## **Principali detrattori**

L'assenza di partecipazioni nelle società a media capitalizzazione NVIDIA, Meta e Apple ha penalizzato la performance relativa. Nvidia ha annunciato una solida guidance sui ricavi, che ha portato a un generale entusiasmo per il potenziale di crescita dell'IA. Continuiamo tuttavia a evitare questi titoli per motivi di valutazione. Il titolo Progressive Corporation è sceso a causa di utili inferiori alle attese. Ciononostante, il quadro dei fondamentali delle nostre attività assicurative è forte, poiché la loro situazione patrimoniale resta solida e la crescita degli utili è resiliente. La società farmaceutica Roche ha perso terreno dopo aver preannunciato un calo degli utili per l'esercizio 2023 a causa della minore domanda di terapie e kit diagnostici per il COVID-19.

## **Principali contributi**

WW Grainger e Schneider Electric hanno registrato un buon andamento nel periodo, grazie a solidi risultati trimestrali superiori alle aspettative del mercato. La crescita della prima è stata supportata da efficienze di trasporto, vischiosità dei prezzi e un allentamento delle tensioni nelle catene di fornitura. Entrambe le società hanno successivamente migliorato la guidance sull'esercizio. In altro ambito, il titolo Munich Re è cresciuto grazie a risultati trimestrali migliore delle attese. La società tedesca di riassicurazione ha confermato la propria guidance di un utile netto di 4 miliardi di euro nell'anno, aggiungendo che il superamento di questo obiettivo ora è più probabile.

## **Strategia e posizionamento del portafoglio**

### **Portafoglio ben diversificato con focus su titoli difensivi di qualità**

Il gestore del portafoglio mantiene una strategia difensiva e resta ben diversificato sia a livello regionale che settoriale, in linea con la strategia che punta su società con rendimenti resilienti e una solida situazione patrimoniale. Il settore con il peso maggiore assoluto e relativo è quello dei finanziari. A ogni modo, le partecipazioni nel settore sono prevalentemente aziende di qualità superiore e difensive con ridotto rischio patrimoniale. Anche sugli industriali abbiamo un notevole sovrappeso, con partecipazioni in gruppi editoriali e di servizi di informazione come Wolters Kluwer e RELX, che godono di un'alta percentuale di ricavi ricorrenti. Il nostro peso significativo nel settore tecnologico comprende aziende tecnologiche hardware e software. Abbiamo inoltre un modesto sovrappeso sui beni di prima necessità. Al tempo stesso, il Fondo è sottopesato nelle aree più critiche del mercato, come materiali ed energia, e su società con flussi di cassa scarsi o negativi. Monitoriamo l'esposizione geografica del Fondo sia in base al Paese di domicilio sia, soprattutto, alle aree in cui le aziende generano i loro ricavi sottostanti. L'esposizione regionale maggiore in valore assoluto è su aziende domiciliate negli Stati Uniti. Si tratta di un significativo sottopeso rispetto all'ampia esposizione dell'indice verso gli Stati Uniti. Tuttavia, il portafoglio risulta marginalmente sovrappeso a livello di ricavi negli Stati Uniti rispetto all'indice. Per contro, l'Europa risulta significativamente sovrappesata se si considera il domicilio, ma molto meno a livello di vendite. Questa differenza deriva dalla natura globale delle attività in cui investe la strategia. Wolters Kluwer, ad esempio, è quotata nei Paesi Bassi ma genera la maggior parte dei ricavi negli Stati Uniti.

# onemarkets Fund

---

## **Prospettive**

- La leadership di mercato quest'anno è stata ristretta, con alcuni titoli growth a grande capitalizzazione come migliori outperformer, dopo la debolezza del 2022 e spinti dall'entusiasmo degli investitori per l'intelligenza artificiale. Le elevate valutazioni in alcuni segmenti del mercato restano vulnerabili a una contrazione, soprattutto se inflazione e tassi d'interesse resteranno più alti più a lungo del previsto. Il bias relativo alle valutazioni della nostra strategia significa che siamo sottoesposti a segmenti del mercato ad alta crescita e con valutazioni elevate. La nostra attenzione continua per la persistenza degli utili dovrebbe inoltre rivelarsi efficace, qualora si concretizzasse il rischio di recessione e pressione sugli utili.
- Continueremo a investire in imprese sostenibili di qualità con situazioni patrimoniali solide e valutazioni interessanti, dove abbiamo un elevato grado di fiducia nella persistenza dei flussi di cassa per l'intero ciclo, fattore che può supportare la distribuzione di un dividendo interessante e in crescita.
- Lo spostamento su larga scala verso un'economia sostenibile a livello globale dovrebbe continuare a offrire fonti di crescita dei dividendi a lungo termine in una serie di settori. Mentre consumatori, legislatori e investitori prestano sempre più attenzione agli aspetti della sostenibilità, la gestione dei rischi ambientali e sociali costituirà una parte importante degli strumenti a disposizione degli investitori per evitare maggiori costi normativi, contenziosi, erosione dei marchi o attivi non recuperabili, che finiscono per influire sui flussi di cassa e sulla capacità di produrre una crescita dei dividendi a lungo termine. Imprese sostenibili e ben governate che gestiscono in modo efficace gli aspetti ambientali e sociali sono ben posizionate per ottenere utili resilienti nel lungo periodo, supportando la crescita dei dividendi e del prezzo del titolo nel lungo termine.

## **Performance delle classi di azioni**

Le classi di azioni di onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund hanno conseguito i seguenti rendimenti:

- |  |        |
|--|--------|
| • A (ISIN: LU2503842119) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 10,20% |
| • AD (ISIN: LU2503842036) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:   | 10,21% |
| • C (ISIN: LU2503841905) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 9,91%  |
| • CD (ISIN: LU2503841814) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:   | 9,90%  |
| • M (ISIN: LU2503841731) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 10,17% |
| • MD (ISIN: LU2503838604) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:   | 10,17% |
| • O (ISIN: LU2503838513) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:    | 10,37% |
| • OD (ISIN: LU2503838430) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:   | 10,35% |
| • U (ISIN: LU2503836905) per il periodo dal 19 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:   | 11,17% |
| • UD (ISIN: LU2503835410) per il periodo dal 12 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:  | 12,89% |
| • D (ISIN: LU2503835337) per il periodo dal 19 ottobre 2022 al 30 giugno 2023:   | 9,10%  |
| • E (ISIN: LU2503835253) per il periodo dal 29 settembre 2022 al 30 giugno 2023: | 12,82% |

## **Obblighi di informativa ai sensi dell'SFDR**

L'informativa obbligatoria periodica ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088 per il Comparto si trova nella sezione Altre informazioni (non certificate), al punto 5.

# onemarkets Fund

---

onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund

## Panoramica del mercato

Il portafoglio di Onemarkets Fund - onemarkets ha sovraperformato il benchmark (MSCI Emerging Markets) dal lancio (3 ottobre 2022) al 30 giugno 2023, grazie al contributo alla performance relativa apportato dalla selezione dei titoli e dall'allocazione settoriale e geografica.

La selezione dei titoli a Taiwan ha favorito i rendimenti relativi, perché i titoli tecnologici di Taiwan sono tornati alla ribalta negli ultimi sei mesi. Un'ampia ridefinizione delle aspettative di crescita legate all'intelligenza artificiale (IA) e le speranze di una svolta nel ciclo dei titoli tecnologici hardware sono stati i principali artefici di questa significativa sovraperformance. Di conseguenza, l'esposizione del portafoglio a Taiwan Semiconductor Manufacturing Company e a Global Unichip hanno offerto importanti contributi ai rendimenti.

Anche la selezione dei titoli in India ha contribuito alla performance. In questo caso, il contributo è derivato principalmente dall'esposizione al settore dei servizi finanziari, con un importante contributo da HDFC Bank. L'economia indiana ha continuato a crescere in modo sostenuto, spingendo la domanda di finanziamenti e mutui. Inoltre, la performance ha beneficiato anche dell'assenza di esposizione al conglomerato multinazionale Adani Group, che ha registrato una consistente correzione dopo che il rapporto di un venditore allo scoperto aveva messo in dubbio le pratiche contabili e di governance. Il portafoglio non deteneva questi titoli a causa del basso flottante, delle valutazioni elevate e dell'alta leva finanziaria.

La selezione dei titoli in Indonesia ha favorito la performance. Bank Rakyat Indonesia e Bank Central Asia hanno sovraperformato grazie a un programma credibile di riforme interne e al rafforzamento dei prezzi delle materie prime, che hanno favorito la crescita economica della regione. La crescita dei finanziamenti e l'ampliamento dei margini hanno guidato il miglioramento dei risultati di entrambe le banche.

Un contributo alla performance è stato offerto anche dalla selezione dei titoli in Brasile, dove gli investitori hanno previsto l'avvio di un ciclo di allentamento dei tassi d'interesse, dopo che a maggio l'inflazione aveva toccato i minimi da due anni e mezzo. Di conseguenza, l'esposizione del portafoglio a B3 SA Brasil Bolsa Balcao, borsa valori brasiliana, ha apportato un importante contributo ai rendimenti, poiché la società ha beneficiato dei maggiori volumi di intermediazione sulla scia di questa sorpresa positiva.

L'assenza di esposizione ad alcuni Paesi del Golfo (Emirati Arabi Uniti, Kuwait e Qatar), oltre al sottopeso sull'Arabia Saudita, hanno contribuito in modo significativo ai rendimenti relativi, dato che questi Paesi hanno sottoperformato rispetto all'indice generale MSCI EM.

Il sovrappeso del portafoglio sul Messico ha contribuito ai rendimenti. Le azioni messicane si sono dimostrate più difensive dell'indice generale, in scia alle aspettative di calo dell'inflazione e a minori timori di una pesante recessione negli Stati Uniti.

Sul fronte negativo, la selezione dei titoli in Cina ha penalizzato i rendimenti relativi a causa della delusione sui tempi di riapertura e della ripresa, che ha inciso sulle azioni detenute nel Paese. In particolare, l'esposizione del portafoglio a Wuxi Biologics, organizzazione globale di ricerca, sviluppo e produzione a contratto, è stata ridotta a causa dei timori per le tensioni geopolitiche. Durante il periodo, è stato introdotto un ordine esecutivo del Presidente Biden volto ad ampliare la capacità di produzione di prodotti biologici negli Stati Uniti, con effetti sulla performance complessiva del titolo. Anche i nomi legati al settore dei consumi hanno subito una flessione, data la ripresa poco incoraggiante nel post-Covid.

Il sottopeso sulla Corea del Sud ha penalizzato i rendimenti relativi a causa del solido andamento del mercato nel periodo. Anche la selezione dei titoli in questo mercato ha avuto un impatto negativo (NCsoft, KB Financial, e LG Household & Health Care).

Per quanto riguarda i titoli, EPAM Systems, l'azienda bielorusa di servizi IT, ha influito negativamente sui rendimenti dopo che la società ha abbassato le previsioni sui ricavi subito dopo la pubblicazione dei risultati.

Sulla base della nostra visione fondamentale, il portafoglio continua a essere sovrappeso su Taiwan (grazie alle valutazioni interessanti), Argentina e Messico, mentre resta sottopeso su Arabia Saudita, Malaysia e India. A livello settoriale, il portafoglio mantiene il sovrappeso su beni di consumo di prima necessità, finanziari e informatica, e il sottopeso su materiali, energia e servizi di comunicazione. Si tratta di una combinazione di temi ad alta convinzione in tutta la piattaforma EMAP, come quello dell'e-commerce e della penetrazione finanziaria, così prevalente nei mercati emergenti.

# onemarkets Fund

---

## Performance delle classi di azioni

Le classi di azioni di onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund hanno conseguito i seguenti rendimenti:

- A (ISIN: LU2503834520) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 1,13%
- C (ISIN: LU2503834447) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 0,94%
- M (ISIN: LU2503834363) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 1,08%
- MD (ISIN: LU2503834280) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 1,17%
- O (ISIN: LU2503834108) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 1,42%
- OD (ISIN: LU2503834017) per il periodo dal 6 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 1,53%
- U (ISIN: LU2503833985) per il periodo dal 21 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 7,09%
- UD (ISIN: LU2503833803) per il periodo dal 23 novembre 2022 al 30 giugno 2023: 2,64%
- D (ISIN: LU2503833712) per il periodo dal 19 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,89%
- E (ISIN: LU2503833639) per il periodo dal 30 settembre 2022 al 30 giugno 2023: 5,90%

## Obblighi di informativa ai sensi dell'SFDR

L'informativa obbligatoria periodica ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088 per il Comparto si trova nella sezione Altre informazioni (non certificate), al punto 5.

# onemarkets Fund

---

onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund

## **Analisi dei mercati**

Nel quarto trimestre 2022, la volatilità è continuata: i rendimenti dei mercati sviluppati sono ampiamente saliti nel corso del trimestre, mentre le banche centrali hanno continuato a inasprire la politica monetaria in risposta alle persistenti pressioni inflazionistiche. La Federal Reserve ha alzato i tassi ufficiali di riferimento e ha spostato al rialzo il tasso terminale inizialmente previsto. Analogamente, diverse altre banche centrali hanno continuato a implementare politiche monetarie più restrittive, inclusa la Bank of Japan, che ha sorpreso i mercati con un adeguamento della politica di controllo della curva dei rendimenti. L'indice S&P 500 ha concluso il quarto trimestre con guadagni modesti, chiudendo il suo anno peggiore dal 2008.

Nel primo trimestre 2023, il quadro fondamentale ha evidenziato segni di rallentamento nel contesto di instabilità del settore finanziario, mentre l'inflazione ha continuato a diminuire. La volatilità dei tassi è salita ai livelli della Grande Crisi Finanziaria in scia alla fragilità del settore bancario, e il mese di marzo ha segnato il più forte calo mensile dal 2008 per i Treasury a due anni. La Fed ha alzato il tasso di riferimento e ha smorzato le aspettative di ulteriori rialzi. Le banche centrali globali hanno perlopiù seguito l'esempio, inasprendo la politica monetaria e abbassando la guidance previsionale, mentre i rendimenti dei mercati sviluppati sono scesi nel corso del trimestre. Nel frattempo la propensione al rischio è migliorata, nonostante il crollo della Silicon Valley Bank e la fusione Credit Suisse-UBS, con l'indice MSCI World in rialzo del 7,7%.

Nel secondo trimestre 2023, i mercati hanno tirato il fiato dopo la risoluzione sul tetto del debito e le proiezioni sui tassi hanno spinto al rialzo, grazie alla resilienza dei dati sull'occupazione e all'attenuazione dei timori per le tensioni nel settore bancario. Le banche centrali globali dei Paesi sviluppati hanno proseguito i loro cicli di rialzo, mantenendo una guidance previsionale restrittiva a causa dei segnali di un'inflazione persistente. La propensione al rischio è stata buona, malgrado i timori per il tetto sul debito statunitense, con l'indice MSCI World che ha chiuso il trimestre in rialzo del 6,99% e un'ampia contrazione degli spread.

## **Analisi della performance**

Al 30 giugno 2023 onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund – A Class ha conseguito un rendimento del 2,08% dal lancio (11 ottobre 2022), al netto di tutte le commissioni. Nello stesso periodo il Fondo ha registrato una volatilità del 7,18% sulla base dei rendimenti mensili.

L'esposizione all'azionario statunitense ha offerto il contributo maggiore al Fondo dal lancio, grazie al rally dell'azionario statunitense nel periodo. Inoltre, l'esposizione ad altri mercati sviluppati (tra cui l'Eurozona) ha contribuito positivamente alla performance del periodo. Anche le strategie sui tassi d'interesse hanno offerto un contributo positivo alla performance del periodo: il contributo positivo maggiore è dovuto all'esposizione alla duration nominale e reale nell'Eurozona, per contro l'esposizione alla duration nominale negli Stati Uniti ha pesato in negativo sulla performance. Anche le strategie sul credito hanno contribuito alla performance, anche se in misura minore, attraverso l'esposizione allo spread investment grade.

## **Attività di posizionamento e gestione del portafoglio**

onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund è stato lanciato l'11 ottobre 2022 e da allora il team di gestione del portafoglio lavora allo sviluppo del portafoglio per avvicinarsi gradualmente all'allocazione target.

A fine giugno 2023 il Fondo deteneva circa il 50% delle attività in obbligazioni nominali, circa il 35% in azioni e il 15% in titoli indicizzati all'inflazione, con focus sui mercati sviluppati rispetto agli emergenti sia nella componente azionaria che in quella obbligazionaria. Nella componente azionaria, l'esposizione preferita è verso l'azionario statunitense (22% circa), ma il portafoglio è esposto anche alle azioni di altri mercati sviluppati (9% circa), inclusa l'Eurozona (3% circa). Nella componente obbligazionaria, la preferenza è per titoli di elevata qualità, tra cui i titoli di Stato dei principali Paesi sviluppati globali (22% circa) e il credito investment grade, che preferiamo a quello high yield. Inoltre, il portafoglio mantiene un'esposizione a obbligazioni indicizzate all'inflazione con duration ridotta, che possono aiutare a mitigare i rischi d'inflazione. In sintesi, il portafoglio ha assunto un posizionamento di rischio neutrale, nel tentativo di bilanciare la resilienza macroeconomica a breve termine con i rischi di recessione a medio termine.

# onemarkets Fund

---

## **Performance delle classi di azioni**

Le classi di azioni di onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund hanno conseguito i seguenti rendimenti:

- A (ISIN: LU2503835501) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,42%
- AD (ISIN: LU2503835683) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,42%
- C (ISIN: LU2503835766) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,22%
- CD (ISIN: LU2503835840) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,22%
- M (ISIN: LU2503838273) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,42%
- MD (ISIN: LU2503837978) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,43%
- O (ISIN: LU2503837895) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,81%
- OD (ISIN: LU2503837622) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,69%
- U (ISIN: LU2503837549) per il periodo dal 14 novembre 2022 al 30 giugno 2023: 1,39%
- UD (ISIN: LU2503837465) per il periodo dal 25 novembre 2022 al 30 giugno 2023: 0,48%
- E (ISIN: LU2503837200) per il periodo dall'11 ottobre 2022 al 30 giugno 2023: 2,99%

## **Obblighi di informativa ai sensi dell'SFDR**

L'informativa obbligatoria periodica ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088 per il Comparto si trova nella sezione Altre informazioni (non certificate), al punto 5.

# onemarkets Fund

---

Comparto lanciato il 30 giugno 2023:

I seguenti Comparti, che sono stati lanciati il 30 giugno 2023:

- onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund
- onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund
- onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund
- onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund
- onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund
- onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund
- onemarkets Global Multibrand Selection Fund
- onemarkets Balanced Eastern Europe Fund
- onemarkets Multi-Asset Value Fund

Per i seguenti Comparti, l'informativa obbligatoria periodica prevista ai sensi del Regolamento (UE) 2019/2088 per il Comparto si trova nella sezione Altre informazioni (non certificate) al punto 5:

- onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund
- onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund
- onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund
- onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund
- onemarkets VP Global Flexible Bond Fund

# **Prospetto integrato di onemarkets Fund**



# onemarkets Fund

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	Nota	Importi in euro
<b>Attività</b>		<b>2.280.176.210,20</b>
Portafoglio titoli a valore di mercato	2b	2.135.878.199,80
<i>Prezzo di costo</i>	2f	2.075.594.797,19
Opzioni (posizioni lunghe) a valore di mercato	2b	4.955.334,51
<i>Opzioni acquistate al costo</i>	2f	6.250.872,67
Depositi bancari		98.626.181,81
Credito per garanzia	10	1.285.663,61
Credito a fronte cessione investimenti		6.664.079,69
Sottoscrizioni da incassare		20.427.211,29
Crediti su swap		59.065,54
Plusvalenza netta non realizzata su contratti forward sui cambi	2b	550.580,02
Plusvalenza netta non realizzata su futures finanziari	2b	48.424,15
Plusvalenza netta non realizzata su swap	2b	2.816.837,13
Dividendi da incassare, netti	2c	2.408.475,66
Interessi da incassare, netti	2c	6.201.694,73
Oneri di costituzione, netti	2i	235.268,07
Altri asset		19.194,19
<b>Passività</b>		<b>68.400.554,79</b>
Opzioni (posizioni corte) a valore di mercato	2b	5.539.932,94
<i>Opzioni vendute al costo</i>	2f	4.438.911,42
Scoperti bancari		386.928,56
Garanzie da versare	10	5.110.096,91
Debiti su investimenti acquistati		42.831.443,93
Debiti per riscatti		2.652.639,69
Debiti per swap		19.048,70
Minusvalenza netta non realizzata su contratti forward sui cambi	2b	561.923,72
Minusvalenza netta non realizzata su futures finanziari	2b	1.965.112,74
Minusvalenza netta non realizzata su swap	2b	225.249,87
Commissioni di gestione dovute	3	5.311.846,90
Commissioni dovute a Depositario, Amministrazione Centrale e Agenti per il pagamento	4.5	1.263.220,65
Imposta di sottoscrizione dovuta ("Taxe d'abonnement")	9	206.298,80
Interessi da corrispondere, netti		1.725.042,83
Debiti su cambi		35.228,30
Altre passività		566.540,25
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>2.211.775.655,41</b>

# onemarkets Fund

## Conto economico integrato e prospetto delle variazioni per l'esercizio dal 15/09/22 (data di costituzione) al 30/06/23

	Nota	Importi in euro
<b>Proventi</b>		<b>27.820.087,69</b>
Dividendi netti	2c	16.512.639,67
Interessi su obbligazioni e strumenti del mercato monetaria, netti	2c	5.344.688,23
Interessi ricevuti su swap		4.769.665,97
Interessi bancari sui conti correnti		1.064.011,65
Altri proventi		129.082,17
<b>Oneri</b>		<b>17.731.423,30</b>
Commissioni di gestione e di consulenza	3	9.098.784,20
Commissioni del Depositario, dell'Amministrazione Centrale e degli Agenti per il pagamento	4.5	2.203.917,76
Ammortamento degli oneri di costituzione	2i	74.393,89
Commissioni di transazione	6	2.293.980,56
Imposta di sottoscrizione ("Taxe d'abonnement")	9	378.094,29
Interessi bancari sugli scoperti		41.175,06
Interessi pagati su swap		2.924.882,46
Altri oneri	2g	716.195,08
<b>Utile / (perdita) netto(a) da investimenti</b>		<b>10.088.664,39</b>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
- vendite di portafoglio titoli	2d	3.251.759,79
- opzioni	2b	3.447.891,79
- contratti di cambio a termine	2b	62.081,72
- futures finanziari	2b	-7.521.843,15
- swap	2b	-3.200.374,99
- cambi	2h	-6.637.287,54
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a)</b>		<b>-509.107,99</b>
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
- portafoglio titoli	2b	60.283.402,61
- opzioni	2b	-2.396.559,68
- contratti di cambio a termine	2b	-11.343,70
- futures finanziari	2b	-1.930.705,45
- swap	2b	2.591.587,26
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette a seguito delle operazioni</b>		<b>58.027.273,05</b>
Dividendi distribuiti	7	-784.223,79
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		2.154.532.606,15
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>2.211.775.655,41</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>2.211.775.655,41</b>

**onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute  
Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)**

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

### Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>107.635.474,21</b>
Portafoglio titoli a valore di mercato	2b	90.861.234,37
<i>Prezzo di costo</i>	2f	90.573.504,14
Opzioni (posizioni lunghe) a valore di mercato	2b	2.621.847,31
<i>Opzioni acquistate al costo</i>	2f	3.447.301,52
Depositi bancari		9.822.637,15
Credito a fronte cessione investimenti		1.919.719,66
Crediti su swap		59.065,54
Plusvalenza netta non realizzata su contratti forward sui cambi	2b	228.677,40
Dividendi da incassare, netti	2c	14.140,49
Interessi da incassare, netti	2c	2.074.410,50
Oneri di costituzione, netti	2i	33.741,79
<b>Passività</b>		<b>6.019.377,05</b>
Opzioni (posizioni corte) a valore di mercato	2b	2.132.484,81
<i>Opzioni vendute al costo</i>	2f	2.038.598,99
Scoperti bancari		37.157,21
Garanzie da versare	10	610.000,00
Debiti su investimenti acquistati		1.104.989,56
Debiti per swap		19.048,70
Minusvalenza netta non realizzata su futures finanziari	2b	451.437,35
Minusvalenza netta non realizzata su swap	2b	225.249,87
Commissioni di gestione dovute	3	128.606,30
Commissioni dovute a Depositario, Amministrazione Centrale e Agenti per il pagamento	4.5	70.729,78
Imposta di sottoscrizione dovuta ("Taxe d'abonnement")	9	2.921,29
Interessi da corrispondere, netti		1.170.481,57
Debiti su cambi		1.499,75
Altre passività		64.770,86
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>101.616.097,16</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Conto economico e variazioni delle attività nette dal 05/10/22 al 30/06/23

	Nota	Importi in euro
<b>Proventi</b>		<b>4.452.188,60</b>
Dividendi netti	2c	151.893,88
Interessi su obbligazioni e strumenti del mercato monetaria, netti	2c	1.541.079,05
Interessi ricevuti su swap		2.602.827,91
Interessi bancari sui conti correnti		153.744,25
Altri proventi		2.643,51
<b>Oneri</b>		<b>3.128.131,16</b>
Commissioni di gestione e di consulenza	3	317.179,83
Commissioni del Depositario, dell'Amministrazione Centrale e degli Agenti per il pagamento	4.5	153.045,11
Ammortamento degli oneri di costituzione	2i	10.534,63
Commissioni di transazione	6	385.550,86
Imposta di sottoscrizione ("Taxe d'abonnement")	9	9.391,19
Interessi bancari sugli scoperti		8.768,90
Interessi pagati su swap		2.159.505,21
Altri oneri	2g	84.155,43
<b>Utile / (perdita) netto(a) da investimenti</b>		<b>1.324.057,44</b>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
- vendite di portafoglio titoli	2d	-891.870,67
- opzioni	2b	2.615.424,66
- contratti di cambio a termine	2b	-431.482,15
- futures finanziari	2b	-9.375.284,58
- swap	2b	-1.517.417,99
- cambi	2h	-1.220.895,89
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a)</b>		<b>-9.497.469,18</b>
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
- portafoglio titoli	2b	287.730,23
- opzioni	2b	-919.340,03
- contratti di cambio a termine	2b	228.677,40
- futures finanziari	2b	-465.454,21
- swap	2b	-225.249,87
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette a seguito delle operazioni</b>		<b>-10.591.105,66</b>
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		112.207.202,82
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>101.616.097,16</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>101.616.097,16</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>101.616.097,16</b>
<b>A - EUR</b>		
Numero di azioni		18.467,674
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	92,21
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		5.533,100
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	92,03
<b>M - EUR</b>		
Numero di azioni		6.282,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	92,23
<b>MD - EUR</b>		
Numero di azioni		13.632,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	92,23
<b>U - EUR</b>		
Numero di azioni		326,006
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	91,71
<b>E - EUR</b>		
Numero di azioni		1.051.961,286
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	92,72

---

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Valori mobiliari ammessi alla quotazione ufficiale in una borsa valori e/o negoziati su un altro mercato regolamentato</b>			<b>86.733.711,52</b>	<b>85,35</b>
<b>Azioni</b>			<b>12.352.800,47</b>	<b>12,16</b>
<b>Canada</b>			<b>311.524,55</b>	<b>0,31</b>
STANTEC INC	CAD	5.200	311.524,55	0,31
<b>Francia</b>			<b>1.955.781,43</b>	<b>1,92</b>
ACCOR SA	EUR	12.777	434.673,54	0,43
ALSTOM	EUR	14.020	383.026,40	0,38
AXA SA	EUR	10.147	274.222,68	0,27
ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	1.284	221.618,40	0,22
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	1.971	328.092,66	0,32
SODEXO SA	EUR	3.115	314.147,75	0,31
<b>Germania</b>			<b>1.197.114,12</b>	<b>1,18</b>
ADIDAS AG NAMEN AKT	EUR	1.491	265.069,98	0,26
SAP AG	EUR	2.793	349.516,02	0,34
SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE	EUR	1.971	300.656,34	0,30
SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	EUR	17.421	281.871,78	0,28
<b>Irlanda</b>			<b>380.554,79</b>	<b>0,37</b>
RYANAIR HLDGS	EUR	22.106	380.554,79	0,37
<b>Italia</b>			<b>323.759,50</b>	<b>0,32</b>
FERRARI	EUR	1.081	323.759,50	0,32
<b>Giappone</b>			<b>2.213.238,59</b>	<b>2,18</b>
AEON CO LTD	JPY	15.200	283.588,38	0,28
ASICS CORP KOBE	JPY	10.900	305.597,08	0,30
FAST RETAILING CO LTD	JPY	1.200	279.438,41	0,27
KIRIN HOLDINGS CO LTD	JPY	19.200	255.877,92	0,25
KONAMI GROUP CORPORATION	JPY	6.200	295.712,35	0,29
ORIENTAL LAND CO LTD	JPY	7.200	255.740,94	0,25
SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	JPY	6.800	267.579,53	0,26
WEST JAPAN RAILWAY COMPANY	JPY	7.100	269.703,98	0,27
<b>Spagna</b>			<b>615.661,26</b>	<b>0,61</b>
AMADEUS IT GROUP SA -A-	EUR	4.821	336.023,70	0,33
INDITEX SHARE FROM SPLIT	EUR	7.886	279.637,56	0,28
<b>Svezia</b>			<b>317.458,16</b>	<b>0,31</b>
HENNES AND MAURITZ AB	SEK	20.202	317.458,16	0,31
<b>Regno Unito</b>			<b>1.335.664,57</b>	<b>1,31</b>
CARNIVAL PLC	GBP	15.641	237.034,56	0,23
CENTRICA	GBP	164.902	238.182,17	0,23
EASYJET PLC	GBP	28.731	161.575,26	0,16
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	GBP	9.477	208.777,82	0,21
INFORMA PLC	GBP	35.497	300.306,73	0,30
WHITBREAD	GBP	4.810	189.788,03	0,19
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>3.702.043,50</b>	<b>3,64</b>
ALPHABET INC -C-	USD	3.511	389.299,42	0,38
BIOGEN IDEC INC	USD	1.143	298.426,72	0,29
DARDEN RESTAURANTS INC	USD	2.158	330.484,55	0,33
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	USD	3.680	274.026,76	0,27
GENERAL ELECTRI	USD	3.429	345.257,24	0,34
META PLATFORMS INC A	USD	1.588	417.712,41	0,41
MICROSOFT CORP	USD	1.027	320.563,32	0,32
NVIDIA CORP	USD	886	343.534,12	0,34
PALO ALTO NETWORKS	USD	1.525	357.151,92	0,35

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
SERVICENOW INC	USD	514	264.759,47	0,26
TERADYNE INC	USD	3.536	360.827,57	0,36
<b>Obbligazioni</b>			<b>58.476.566,29</b>	<b>57,55</b>
<b>Albania</b>			<b>392.432,00</b>	<b>0,39</b>
ALBANIA 5.9 23-28 09/06A	EUR	400.000	392.432,00	0,39
<b>Australia</b>			<b>472.518,55</b>	<b>0,47</b>
AUSTRALIA PACIFIC 4.375 23-33 24/05A	EUR	120.000	119.542,80	0,12
NBN 4.375 23-33 15/03A	EUR	120.000	122.499,00	0,12
SYDNEY AIRPORT FINAN 4.375 23-33 03/05A	EUR	130.000	129.437,75	0,13
TRANSURBAN FINANCE 4.225 23-33 26/04A	EUR	100.000	101.039,00	0,10
<b>Austria</b>			<b>722.275,84</b>	<b>0,71</b>
AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A	EUR	400.000	376.642,00	0,37
SUZANO AUSTRIA GMBH 2.5 21-28 15/09S	USD	190.000	148.490,84	0,15
VORALBERGER LANDESUH 4.125 23-26 16/02A	EUR	200.000	197.143,00	0,19
<b>Belgio</b>			<b>3.213.115,73</b>	<b>3,16</b>
BELGIUM 0.65 21-71 22/06A	EUR	940.000	391.528,80	0,39
EUROPEAN UNION 0.00 20-30 04/10A	EUR	505.000	407.706,70	0,40
EUROPEAN UNION 0.8 22-25 04/07A	EUR	945.000	896.790,83	0,88
EUROPEAN UNION 0 21-26 06/07A	EUR	785.000	712.858,50	0,70
EUROPEAN UNION 0 21-31 04/07A	EUR	675.000	532.912,50	0,52
EUROPEAN UNION 3.0 22-53 04/03A	EUR	180.000	171.671,40	0,17
KBC GROUPE 4.375 23-31 06/12A	EUR	100.000	99.647,00	0,10
<b>Bermuda</b>			<b>188.525,60</b>	<b>0,19</b>
ATHORA 6.625 23-28 16/06A	EUR	190.000	188.525,60	0,19
<b>Brasile</b>			<b>2.035.916,21</b>	<b>2,00</b>
BRAZIL 0.01 22-33 01/01S	BRL	5.000	917.269,62	0,90
BRAZIL 10.00 18-29 05/01S	BRL	6.000	1.118.646,59	1,10
<b>Bulgaria</b>			<b>396.868,00</b>	<b>0,39</b>
BULGARIA 4.125 22-29 23/09A	EUR	200.000	198.359,00	0,20
BULGARIA 4.5 23-33 27/01A	EUR	200.000	198.509,00	0,20
<b>Canada</b>			<b>1.738.111,93</b>	<b>1,71</b>
BANK OF NOVA SCOTIA 4.85 23-30 01/02S	USD	500.000	442.566,45	0,44
CANADA 1.00 21-26 01/09S	CAD	2.050.000	1.295.545,48	1,27
<b>Isole Cayman</b>			<b>530.055,46</b>	<b>0,52</b>
BANCO BTG PACTUAL SA 4.5 19-25 10/01S	USD	300.000	266.256,19	0,26
LAMAR FUNDING LTD 3.958 15-25 07/05S	USD	300.000	263.799,27	0,26
<b>Cile</b>			<b>556.735,28</b>	<b>0,55</b>
CHILE 4.125 23-34 05/07A	EUR	270.000	267.231,15	0,26
CORPORACION NACIONAL 5.125 23-33 02/02S	USD	200.000	181.124,66	0,18
EMPRESA NACIONAL 3.05 21-32 14/09S	USD	150.000	108.379,47	0,11
<b>Colombia</b>			<b>1.046.290,54</b>	<b>1,03</b>
COLOMBIA 3.125 20-31 15/04S	USD	200.000	139.165,91	0,14
COLOMBIA 3.875 16-26 22/03A	EUR	100.000	96.121,00	0,09
COLOMBIA 5.20 19-49 15/05S	USD	340.000	217.573,52	0,21
COLOMBIA 7.5 23-49 02/02S	USD	200.000	179.751,60	0,18
COLOMBIA 8 22-33 20/04S	USD	200.000	187.142,07	0,18
ECOPETROL SA 8.8750 23-33 13/01S	USD	250.000	226.536,44	0,22
<b>Repubblica Ceca</b>			<b>255.816,00</b>	<b>0,25</b>
EP INFRASTRUCTURE AS 1.698 19-26 30/07A	EUR	300.000	255.816,00	0,25

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*



# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Danimarca</b>			<b>468.755,00</b>	<b>0,46</b>
CARLSBERG BREWERIES 3.50 23-26 26/11A	EUR	100.000	98.972,50	0,10
NYKREDIT REALKREDIT A/S 4.0 23-28 17/07A	EUR	250.000	242.057,50	0,24
TDC NET AS 5.618 23-30 06/02A	EUR	130.000	127.725,00	0,13
<b>Repubblica Dominicana</b>			<b>117.191,11</b>	<b>0,12</b>
DOMINICAN REPUBLIC 4.875 20-32 23/09S	USD	150.000	117.191,11	0,12
<b>Finlandia</b>			<b>379.056,80</b>	<b>0,37</b>
NOKIAN RENKAAT OYJ 5.125 23-28 14/06A	EUR	170.000	169.460,25	0,17
STORA ENSO OYJ 4.0 23-26 01/06A	EUR	100.000	99.585,00	0,10
STORA ENSO OYJ 4.25 23-29 01/09A	EUR	110.000	110.011,55	0,11
<b>Francia</b>			<b>5.477.288,88</b>	<b>5,39</b>
ALD SA 4.25 23-27 18/01A	EUR	200.000	199.522,00	0,20
ARVAL SERVICE LEASE 4.125 23-26 13/04A	EUR	200.000	198.255,00	0,20
ARVAL SERVICE LEASE 4.625 23-24 02/12A	EUR	100.000	100.421,50	0,10
BFCM 3.875 23-28 14/02A	EUR	100.000	98.642,50	0,10
BFCM 4.375 23-30 02/05A	EUR	200.000	198.695,00	0,20
BFCM 5.375 23-28 25/05U	GBP	100.000	111.109,94	0,11
BNP PARIBAS SA 2.375 15-25 17/02A	EUR	248.000	239.610,16	0,24
BNP PARIBAS SA 4.125 23-33 24/05A	EUR	200.000	200.227,00	0,20
BOUYGUES 3.875 23-31 17/07A	EUR	100.000	99.174,00	0,10
BPCE SA 2.875 14-24 30/09A	EUR	200.000	195.541,00	0,19
BPCE SA 6.125 23-29 24/05A	GBP	200.000	223.335,08	0,22
CA HOME LOAN 3.25 23-32 28/09A	EUR	500.000	498.237,50	0,49
CARREFOUR BQ 4.079 23-27 05/05A	EUR	200.000	196.940,00	0,19
CREDIT AGRICOLE SA 2.8000 15-25 16/10Q	EUR	100.000	96.269,00	0,09
CROWN EUROPEAN HLDG 2.625 16-24 30/09S9S	EUR	300.000	294.130,50	0,29
DANONE SA 3.47 23-31 22/05A	EUR	200.000	199.232,00	0,20
ERAMET SA 5.8750 19-25 21/05A	EUR	300.000	306.123,00	0,30
HLDG INFRA TRANSPORT 1.625 20-29 18/09A	EUR	300.000	256.825,50	0,25
HLDG INFRA TRANSPORT 4.25 23-30 18/01A	EUR	100.000	99.120,50	0,10
LA POSTE 4.00 23-35 12/06A	EUR	200.000	202.702,00	0,20
RCI BANQUE SA 4.875 23-28 14/06A	EUR	80.000	79.981,20	0,08
RENAULT SA 2.375 20-26 25/11A	EUR	300.000	278.041,50	0,27
SOCIETE GENERALE SA 4.125 23-27 02/06A	EUR	200.000	198.273,00	0,20
SOCIETE GENERALE SA 5.625 23-33 02/06A	EUR	100.000	99.111,00	0,10
TEREOS FIN GROUP I 7.5 20-25 30/10S	EUR	300.000	307.942,50	0,30
VALLOUREC SA 8.5 21-26 30/06S	EUR	300.000	300.280,50	0,30
WENDEL SE 4.5 23-30 19/06A	EUR	100.000	99.554,00	0,10
WPP FINANCE 4.125 23-28 30/05A	EUR	100.000	99.992,00	0,10
<b>Germania</b>			<b>2.779.861,40</b>	<b>2,74</b>
BAYER AG 4.0 23-26 26/08A	EUR	110.000	110.110,55	0,11
BAYER AG 4.625 23-33 26/05A	EUR	70.000	71.178,80	0,07
BOSCH GMBH ROBERT 3.625 23-27 02/06A	EUR	100.000	99.558,00	0,10
BOSCH GMBH ROBERT 3.625 23-30 02/06A	EUR	100.000	99.211,50	0,10
CONTINENTAL 4.0 23-28 01/06A	EUR	190.000	189.020,55	0,19
EUROGRID GMBH 1 3.722 23-30 27/04A	EUR	200.000	198.234,00	0,20
HAMBURG COMMERCIAL 4.875 23-25 17/03A	EUR	200.000	199.275,00	0,20
HP PELZER HOLDING GMBH 9.5 23-27 01/04S	EUR	140.000	130.189,50	0,13
KFW 0 19-26 30/09A	EUR	700.000	631.214,50	0,62
KFW 0 20-30 17/09A	EUR	1.300.000	1.051.869,00	1,04
<b>Ungheria</b>			<b>313.076,62</b>	<b>0,31</b>
HUNGARY 2.125 21-31 22/09S	USD	270.000	192.203,62	0,19
HUNGARY 5.0000 22-27 22/02A	EUR	120.000	120.873,00	0,12

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Islanda</b>			<b>119.512,20</b>	<b>0,12</b>
ARION BANK 7.25 23-26 25/05A	EUR	120.000	119.512,20	0,12
<b>India</b>			<b>181.354,72</b>	<b>0,18</b>
REC LTD 5.625 23-28 11/04S	USD	200.000	181.354,72	0,18
<b>Indonesia</b>			<b>996.090,28</b>	<b>0,98</b>
INDONESIA 1 21-29 28/07A	EUR	350.000	291.705,75	0,29
INDONESIA 3.2 21-61 23/09S	USD	320.000	200.077,73	0,20
INDONESIA 4.65 22-32 20/09S	USD	200.000	180.193,40	0,18
INDONESIA 7 22-33 15/02S	IDR	5.017.000.000	324.113,40	0,32
<b>Irlanda</b>			<b>4.342.223,84</b>	<b>4,27</b>
AMUNDI PHYSICAL METALS PLC - GOLD	USD	57.363	4.008.679,97	3,94
STEAS FUNDING 1 DAC 7.23 22-26 17/03S	USD	250.000	219.980,67	0,22
VODAFONE INTERNATIONAL 4.0 23-43 10/02A	EUR	120.000	113.563,20	0,11
<b>Isola di Man</b>			<b>99.661,50</b>	<b>0,10</b>
PLAYTECH PLC 5.8750 23-28 28/06S	EUR	100.000	99.661,50	0,10
<b>Italia</b>			<b>7.136.201,41</b>	<b>7,02</b>
2I RETE GAS 4.375 23-33 06/06A	EUR	140.000	138.124,00	0,14
ACQUIRENTE UNICO S.P. 2.8 19-26 20/02A	EUR	400.000	381.698,00	0,38
AMCO AM COMPANY 4.625 23-27 06/02A	EUR	160.000	159.076,00	0,16
ASSICURAZI GENERALI 5.399 23-33 20/04A	EUR	200.000	202.566,00	0,20
ASTM SPA 1.0 21-26 25/11A	EUR	100.000	89.272,50	0,09
ATLANTIA SPA 1.625 17-25 03/02A	EUR	300.000	286.642,50	0,28
AUTOSTRADE ITALIA SPA 4.75 23-31 24/01A	EUR	100.000	98.862,00	0,10
AUTOSTRADE ITALIA SPA 5.125 23-33 14/06A	EUR	100.000	100.340,50	0,10
BANCA MPS SPA 2.625 20-25 28/01A	EUR	300.000	281.305,50	0,28
BANCA MPS SPA 3.625 19-24 24/09A	EUR	200.000	194.540,00	0,19
BANCO BPM SPA 3.75 23-28 27/06A	EUR	140.000	139.552,00	0,14
BANCO BPM SPA 4.875 23-27 18/01A	EUR	280.000	278.164,60	0,27
BANCO BPM SPA 6.00 23-28 14/06A	EUR	170.000	169.076,90	0,17
CASSA DEPOSITI 3.875 23-29 13/02A	EUR	100.000	98.894,50	0,10
CASSA DEPOSITI 5.7500 23-26 05/05S	USD	400.000	362.025,66	0,36
DOVALUE SPA 3.375 21-26 31/07S	EUR	200.000	169.106,00	0,17
DOVALUE SPA 5.00 20-25 04/08S	EUR	200.000	189.742,00	0,19
ENI SPA 3.625 23-27 19/05A	EUR	130.000	127.979,80	0,13
ENI SPA 4.25 23-33 19/05A	EUR	130.000	129.130,95	0,13
FERROVIE STATO ITALIA 1.125 19-26 09/07A	EUR	300.000	275.472,00	0,27
FERROVIE STATO ITALIA 4.125 23-29 23/05A	EUR	160.000	158.547,20	0,16
FERROVIE STATO ITALIA 4.5 23-33 23/05A	EUR	180.000	180.388,80	0,18
ILLIMITY BANK SPA 6.625 22-25 09/12A	EUR	240.000	241.564,80	0,24
INTESA SANPAOLO SPA 4.00 23-26 19/05A	EUR	160.000	158.430,40	0,16
INTESA SANPAOLO SPA 5.625 23-33 08/03A	EUR	190.000	189.910,70	0,19
INTESA SANPAOLO SPA 6.50 23-29 14/03S	GBP	160.000	175.424,81	0,17
INTESA SANPAOLO SPA 6.625 23-33 20/06S	USD	200.000	182.330,89	0,18
INTESA SANPAOLO SPA 6.625 23-33 31/05S	GBP	170.000	190.362,76	0,19
ITALGAS 4.125 23-32 08/06A	EUR	100.000	98.106,50	0,10
LEASYS SPA 4.375 22-24 07/12A	EUR	110.000	109.637,00	0,11
PIRELLI C 4.25 23-28 18/01A	EUR	100.000	98.527,50	0,10
SEASPA 3.50 20-25 09/10A	EUR	300.000	285.625,50	0,28
TELECOM ITALIA SPA 3.625 16-24 19/01A	EUR	400.000	396.622,00	0,39
TELECOM ITALIA SPA 4 19-24 11/04A	EUR	300.000	296.470,50	0,29
TELECOM ITALIA SPA 6.875 23-28 15/02S	EUR	240.000	239.649,60	0,24
TERNA RETE ELETTRICA 3.625 23-29 21/04A	EUR	267.000	263.031,04	0,26
<b>Giappone</b>			<b>478.520,05</b>	<b>0,47</b>
JAPAN 0.4 19-49 20/06S	JPY	11.000.000	57.431,18	0,06

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
JAPAN 0.5 18-38 20/12S	JPY	25.000.000	151.911,02	0,15
MIZU FI 4.416 23-33 20/05A	EUR	270.000	269.177,85	0,26
<b>Jersey</b>			<b>2.719.132,43</b>	<b>2,68</b>
AVIS BUDGET FINANCE 4.50 17-25 15/05S	EUR	300.000	295.774,50	0,29
TVL FINANCE 10.25 23-28 28/04S	GBP	210.000	240.029,89	0,24
WISDOMTREE COMMODITY SEC - BRENT CRUDE OIL	USD	16.026	638.175,59	0,63
WISDOMTREE COMMODITY SEC - UBS ALUMINIUM	USD	80.805	214.714,67	0,21
WISDOMTREE COMMODITY SEC - UBS COPPER	USD	3.702	113.248,63	0,11
WISDOMTREE COMMODITY SEC - UBS NICKEL	USD	6.430	112.495,54	0,11
WISDOMTREE COMMODITY SEC - UBS ZINC	USD	8.441	60.425,49	0,06
WISDOMTREE COMMODITY SEC - WTI CRUDE OIL	USD	51.252	393.374,37	0,39
WISDOMTREE METAL SECURITIES - PALLADIUM	USD	1.650	174.603,57	0,17
WISDOMTREE METAL SECURITIES - PLATINUM	USD	3.463	267.469,94	0,26
WISDOMTREE METAL SECURITIES - SILVER	USD	10.850	208.820,24	0,21
<b>Lussemburgo</b>			<b>943.890,41</b>	<b>0,93</b>
ARCE MI 4.875 22-26 26/09A	EUR	200.000	204.220,00	0,20
CSN RESOURCES SA 4.625 21-31 10/06S	USD	300.000	210.127,86	0,21
MOTION FINCO SARL 7.375 23-30 15/06S	EUR	130.000	129.861,55	0,13
ROSSINI SARL 6.75 18-25 30/10S	EUR	200.000	201.961,00	0,20
TRATON FINANCE LUX 4.00 23-25 16/09A	EUR	200.000	197.720,00	0,19
<b>Macedonia</b>			<b>102.262,50</b>	<b>0,10</b>
MACEDONIA 6.25 23-27 15/02A	EUR	100.000	102.262,50	0,10
<b>Messico</b>			<b>2.998.877,82</b>	<b>2,95</b>
BRASKEM NETHERLANDS 7.45 19-29 15/11S	USD	300.000	185.663,16	0,18
MEXICO 2.125 21-51 25/10A	EUR	290.000	166.618,05	0,16
MEXICO 3.25 20-30 16/04S	USD	400.000	326.997,25	0,32
MEXICO 5.4 23-28 09/02S	USD	330.000	307.837,67	0,30
MEXICO 7.50 22-33 26/05S	MXN	155.000	764.214,48	0,75
MEXICO 7.75 11-42 13/11S	MXN	60.000	287.968,70	0,28
MEXICO 8 22-53 31/07S	MXN	125.000	607.156,41	0,60
NEMAK SAB DE CV 3.625 21-31 28/06S	USD	280.000	201.333,09	0,20
PEMEX 6.70 22-32 16/02S	USD	60.000	41.888,64	0,04
PEMEX 6.75 16-47 21/09S9S	USD	190.000	109.200,37	0,11
<b>Paesi Bassi</b>			<b>3.965.404,80</b>	<b>3,90</b>
ABN AMRO BANK NV 3.75 23-25 20/04A	EUR	200.000	198.316,00	0,20
ABN AMRO BANK NV 4.375 23-28 20/10A	EUR	100.000	99.361,50	0,10
AKZO NOBEL NV 4.0 23-33 24/05A	EUR	300.000	290.421,00	0,29
BMW INTL INVESTMENT 5.5 23-26 06/06A	GBP	200.000	229.149,92	0,23
BRASKEM NL FINANCE 4.5 19-30 31/01S	USD	500.000	394.069,66	0,39
BRASKEM NL FINANCE 5.875 19-50 31/01S	USD	200.000	148.680,11	0,15
DAIMLER TRUCK INTL F 3.875 23-26 19/06A	EUR	100.000	99.622,50	0,10
DAIMLER TRUCK INTL F 3.875 23-29 19/06A	EUR	100.000	99.144,00	0,10
DUFREY ONE BV 2.50 17-24 15/10S	EUR	300.000	293.724,00	0,29
DUFREY ONE BV 3.625 21-26 22/04S	CHF	200.000	197.010,40	0,19
HEIMSTADEN BOSTAD TSY 0.25 21-24 13/10A	EUR	150.000	131.948,25	0,13
ING GROEP NV 4.50 23-29 23/05A	EUR	200.000	198.118,00	0,19
MERCEDESBENZ INTL FIN 3.50 23-26 30/05A	EUR	150.000	149.070,00	0,15
NE PROPERTY BV 1.8750 19-26 09/10A	EUR	300.000	260.790,00	0,26
NIBC BANK NV 6.3750 23-25 01/12A	EUR	200.000	198.845,00	0,20
PETROBRAS GLOBAL FIN 6.5 23-33 03/07S	USD	400.000	359.099,91	0,35
PROSUS NV 3.257 22-27 19/01S	USD	350.000	291.217,00	0,29
RELX FINANCE BV 3.75 23-31 12/06A	EUR	100.000	100.036,00	0,10
STELLANTIS NV 4.2500 23-31 16/06A	EUR	130.000	128.184,55	0,13
VOLKSWAGEN INTL FIN 3.875 23-26 29/03A	EUR	100.000	98.597,00	0,10

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Nuova Zelanda</b>			<b>256.525,71</b>	<b>0,25</b>
NEW ZEALAND 2.75 21-51 15/05S	NZD	660.000	256.525,71	0,25
<b>Panama</b>			<b>191.403,30</b>	<b>0,19</b>
PANAMA 6.4 22-35 14/02S	USD	200.000	191.403,30	0,19
<b>Perù</b>			<b>239.517,30</b>	<b>0,24</b>
PERU 1.95 21-36 17/11A	EUR	330.000	239.517,30	0,24
<b>Filippine</b>			<b>46.122,11</b>	<b>0,05</b>
ASIA DEV BK 0.00 23-43 20/04U	MXN	5.000.000	46.122,11	0,05
<b>Polonia</b>			<b>785.771,18</b>	<b>0,77</b>
POLAND 4.875 23-33 04/10S	USD	350.000	315.452,34	0,31
POLAND 5.5 22-27 16/11S	USD	210.000	197.790,75	0,19
POLAND 5.5 23-53 04/04S	USD	180.000	166.549,49	0,16
POLAND 5.75 22-32 16/11S	USD	110.000	105.978,60	0,10
<b>Portogallo</b>			<b>309.699,00</b>	<b>0,30</b>
NOVO BANCO, S.A. 3.0 23-33 01/06A	EUR	300.000	309.699,00	0,30
<b>Qatar</b>			<b>307.979,83</b>	<b>0,30</b>
QATAR PETROLEUM 2.25 21-31 12/07S	USD	400.000	307.979,83	0,30
<b>Romania</b>			<b>1.170.733,84</b>	<b>1,15</b>
ROMANIA 2.0 21-33 14/04A	EUR	250.000	177.055,00	0,17
ROMANIA 3.3750 20-50 28/01A	EUR	70.000	44.027,20	0,04
ROMANIA 5 22-26 27/09A	EUR	350.000	351.995,00	0,35
ROMANIA 6.625 22-29 27/09A	EUR	420.000	437.108,70	0,43
ROMANIA 6.625 23-28 17/02S	USD	170.000	160.547,94	0,16
<b>Sudafrica</b>			<b>382.621,36</b>	<b>0,38</b>
SOUTH AFRICA 5.875 22-32 20/04S	USD	470.000	382.621,36	0,38
<b>Spagna</b>			<b>436.511,00</b>	<b>0,43</b>
ACCIONA ENERGIA FIN 3.75 23-30 25/04A	EUR	100.000	98.252,00	0,10
NH HOTEL GROUP S.A 4 21-26 28/06S	EUR	250.000	239.042,50	0,24
NT CONS FIN 4.125 23-28 05/05A	EUR	100.000	99.216,50	0,10
<b>Svezia</b>			<b>818.534,37</b>	<b>0,81</b>
INTRUM AB 3.5000 19-26 15/07S	EUR	200.000	149.121,00	0,15
INTRUM AB 4.875 20-25 05/08S	EUR	200.000	166.280,00	0,16
SEB 5.5 23-26 01/06A	GBP	150.000	169.769,27	0,17
SKANDINAVISKA ENSKIL 3.75 23-28 07/02A	EUR	140.000	135.861,60	0,13
TELE2 AB 3,75% 23-2922/11A	EUR	100.000	98.661,50	0,10
VOLVO TREASURY AB 3.5 23-25 17/11A	EUR	100.000	98.841,00	0,10
<b>Svizzera</b>			<b>2.050.578,87</b>	<b>2,02</b>
SWITZERLAND 0 19-34 26/06U	CHF	350.000	324.061,52	0,32
SWITZERLAND 1.25 14-26 28/05A	CHF	350.000	359.974,13	0,35
SWITZERLAND 1.50 13-25 24/07A	CHF	500.000	515.409,05	0,51
SWITZERLAND 2.50 06-36 08/03A	CHF	700.000	851.134,17	0,84
<b>Regno Unito</b>			<b>2.146.309,51</b>	<b>2,11</b>
3I GROUP 4.875 23-29 14/06A	EUR	240.000	236.986,80	0,23
DIAGEO FINANCE PLC 3.50 23-25 26/06A	EUR	200.000	198.643,00	0,20
EUROPEAN BANK RECONS 0.00 22-32 19/01U	MXN	4.000.000	94.783,87	0,09
INEOS FINANCE PLC 6.625 23-28 15/05S	EUR	100.000	98.518,50	0,10
LLOYDS BANK CORPORAT 4.125 23-27 30/05A	EUR	100.000	98.840,00	0,10
MARB BONDCO PLC 3.95 21-31 29/01S	USD	210.000	137.856,05	0,14
NATWEST MKTS 6.625 23-26 22/06A	GBP	130.000	150.198,74	0,15
NORTHERN GAS NETWORK 6.125 23-33 02/06A	GBP	100.000	115.239,76	0,11
TESCO CORP TREAS SERV 5.5 23-35 27/02A	GBP	100.000	107.806,91	0,11

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
THE CO-OPERATIVE BANK 9.0 20-25 27/11S	GBP	300.000	349.101,55	0,34
TP ICAP 7.875 23-30 17/04S	GBP	110.000	121.740,26	0,12
UNITED KINGDOM 0.875 21-46 31/01S	GBP	560.000	321.532,60	0,32
WEIR GROUP PLC 6.8750 23-28 14/06A	GBP	100.000	115.061,47	0,11
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>4.167.236,00</b>	<b>4,10</b>
AMERICAN TOWER 4.125 23-27 16/05A	EUR	180.000	178.156,80	0,18
AT&T INC 3.95 23-31 30/04A	EUR	130.000	129.004,20	0,13
AUTOLIV 4.25 23-28 15/03A	EUR	100.000	99.333,50	0,10
BANK OF AMERICA CORP 4.134 23-28 12/06A	EUR	120.000	118.966,20	0,12
BOOKING 3.625 23-28 12/11A	EUR	100.000	98.928,50	0,10
BOOKING 4.125 23-33 12/05A	EUR	110.000	109.567,15	0,11
CARGILL INCORPORATE 3.875 23-30 24/04A	EUR	100.000	99.843,00	0,10
FORD MOTOR CREDIT CO 1.744 20-24 19/07A	EUR	200.000	193.582,00	0,19
FORD MOTOR CREDIT CO 6.86 23-26 05/06A	GBP	200.000	227.797,01	0,22
FORD MOTOR CREDIT CO 6.95 23-26 10/06S	USD	200.000	184.303,39	0,18
GENERAL MOTORS FIN 4.5 23-27 22/11A	EUR	170.000	168.818,50	0,17
HP ENTERPRISE C 5.9000 23-24 01/10S	USD	176.000	161.103,72	0,16
IBM CORP 4.00 23-43 06/02A	EUR	130.000	126.974,90	0,12
IBM CORP 4.875 23-38 06/02A	GBP	110.000	114.451,78	0,11
NASDAQ INC 4.5000 23-32 15/02A	EUR	100.000	101.233,00	0,10
NASDAQ INC 5.5500 23-34 15/02S	USD	51.000	46.859,92	0,05
NASDAQ INC 6.1 23-63 28/06S	USD	50.000	46.728,69	0,05
SASOL FINANCING USA 5.875 18-24 27/09S	USD	300.000	271.651,24	0,27
STILLWATER MINI 4.0000 21-26 16/11S	USD	200.000	163.628,78	0,16
UNITED STATES 0.375 20-25 30/04S	USD	750.000	632.299,61	0,62
UNITED STATES 1.25 21-28 30/06S	USD	750.000	597.591,81	0,59
VF CORP 4.125 23-26 07/03A	EUR	120.000	118.933,20	0,12
VF CORP 4.25 23-29 07/03A	EUR	180.000	177.479,10	0,17
<b>Notes a tasso variabile</b>			<b>15.821.025,26</b>	<b>15,57</b>
<b>Austria</b>			<b>196.145,00</b>	<b>0,19</b>
RAIFFEISEN BANK INTL FL.R 23-27 26/01A	EUR	200.000	196.145,00	0,19
<b>Belgio</b>			<b>397.411,00</b>	<b>0,39</b>
KBC GROUPE FL.R 23-26 06/06A	EUR	200.000	198.855,00	0,20
KBC GROUPE SA FL.R 23-30 19/04A	EUR	200.000	198.556,00	0,20
<b>Isole Cayman</b>			<b>163.949,58</b>	<b>0,16</b>
BCO DO BRASIL CAYMAN FL.R 13-XX 15/04S	USD	200.000	163.949,58	0,16
<b>Repubblica Ceca</b>			<b>200.185,00</b>	<b>0,20</b>
CESKA SPORITELNA AS FL.R 23-27 29/06A	EUR	200.000	200.185,00	0,20
<b>Danimarca</b>			<b>348.041,15</b>	<b>0,34</b>
DANSKE BK FL.R 23-30 21/06A	EUR	180.000	179.578,80	0,18
JYSKE BANK DNK FL.R 23-28 26/10A	EUR	170.000	168.462,35	0,17
<b>Finlandia</b>			<b>148.900,48</b>	<b>0,15</b>
NORDEA BANK ABP FL.R 23-26 02/06S	GBP	130.000	148.900,48	0,15
<b>Francia</b>			<b>1.155.777,94</b>	<b>1,14</b>
AXA FL.R 03-XX 29/12Q	EUR	200.000	159.658,00	0,16
BPCE FL.R 23-34 14/06A	EUR	100.000	100.450,50	0,10
CNP ASSURANCES FL.R 23-52 18/07A	EUR	100.000	96.056,50	0,09
CREDIT AGRICOLE SA FL.R 23-31 14/06A	GBP	200.000	229.992,43	0,23
EDF SA FL.R 14-XX 22/01A	EUR	100.000	94.571,00	0,09
EDF SA FL.R 23-XX 15/12S	USD	400.000	375.807,51	0,37
ORANGE SA FL.R 23-XX 18/04A	EUR	100.000	99.242,00	0,10

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Germania</b>			<b>214.479,99</b>	<b>0,21</b>
DEUTSCHE BANK A FL.R 23-30 12/12A	GBP	200.000	214.479,99	0,21
<b>Grecia</b>			<b>461.654,20</b>	<b>0,45</b>
ALPHA BANK AE FL.R 22-25 01/11A	EUR	200.000	202.741,00	0,20
ALPHA BANK AE FL.R 23-29 27/06A	EUR	260.000	258.913,20	0,25
<b>Irlanda</b>			<b>200.170,50</b>	<b>0,20</b>
BANK OF IRELAND GRO FL.R 23-31 04/07A	EUR	100.000	99.982,00	0,10
PERMANENT TSB GROUP FL.R 23-28 25/04A	EUR	100.000	100.188,50	0,10
<b>Italia</b>			<b>2.618.167,28</b>	<b>2,58</b>
BANCA POPOLARE DELL FL.R 22-25 30/06A	EUR	200.000	197.237,00	0,19
BANCO BPM SPA FL.R 22-28 21/01A	EUR	150.000	150.445,50	0,15
BORMIOLI PHARMA FL.R 23-28 15/05Q	EUR	220.000	214.999,40	0,21
BPER BANCA SPA FL.R 22-28 01/02A	EUR	150.000	151.544,25	0,15
CREDITO EMILIAN FL.R 23-29 30/05A	EUR	150.000	151.421,25	0,15
FINE BA FL.R 23-29 23/02A	EUR	120.000	119.367,60	0,12
INTE FL.R 23-25 17/03Q	EUR	170.000	170.073,95	0,17
INTE FL.R 23-54 20/06S	USD	200.000	181.372,13	0,18
INTESA SANPAOLO FL.R 23-34 20/02A	EUR	200.000	198.229,00	0,20
INTESA SANPAOLO SPA FL.R 20-XX 20/06S	EUR	300.000	283.596,00	0,28
MEDIOBANCA FL.R 22-29 07/02A	EUR	100.000	99.848,00	0,10
MONTE PASCHI FL.R 23-26 02/03A	EUR	180.000	180.380,70	0,18
POSTE ITALIANE FL.R 21-XX 24/06A	EUR	300.000	229.141,50	0,23
UNICREDIT SPA FL.R 19-25 25/06A	EUR	300.000	290.511,00	0,29
<b>Jersey</b>			<b>107.792,30</b>	<b>0,11</b>
TVL FINANCE FL.R 23-28 28/04Q	EUR	110.000	107.792,30	0,11
<b>Lussemburgo</b>			<b>200.066,00</b>	<b>0,20</b>
EUROFINS SCIENTIFIC FL.R 23-XX 24/07A	EUR	200.000	200.066,00	0,20
<b>Malta</b>			<b>105.378,00</b>	<b>0,10</b>
BANK OF VALLETTA FL.R 22-27 06/12A	EUR	100.000	105.378,00	0,10
<b>Messico</b>			<b>569.712,75</b>	<b>0,56</b>
BANORTE FL.R 21-XX 24/01Q	USD	400.000	284.033,00	0,28
CEMEX SAB DE CV FL.R 23-XX 14/06S	USD	200.000	185.942,25	0,18
PEMEX FL.R 18-23 24/08Q	EUR	100.000	99.737,50	0,10
<b>Paesi Bassi</b>			<b>1.384.871,72</b>	<b>1,36</b>
COOPERATIEVE RABOB FL.R 23-29 25/04A	EUR	200.000	197.884,00	0,19
FRIESLANDCAMPINA NV FL.R 20-XX 10/12A	EUR	100.000	90.401,00	0,09
ING GROEP NV FL.R 23-33 20/05S	GBP	300.000	324.499,22	0,32
IPD 3 BV FL.R 23-28 15/06Q	EUR	100.000	100.014,50	0,10
TELEFONICA EUROPE BV FL.R 23-XX 03/05A	EUR	200.000	193.660,00	0,19
VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 18-XX 27/06A	EUR	300.000	290.175,00	0,29
VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 20-XX 17/06A	EUR	200.000	188.238,00	0,19
<b>Romania</b>			<b>307.155,00</b>	<b>0,30</b>
BANCA COMERCIALA ROM FL.R 23-27 19/05A	EUR	300.000	307.155,00	0,30
<b>Spagna</b>			<b>3.614.008,08</b>	<b>3,56</b>
ABANCA CORPORACION B FL.R 23-26 18/05A	EUR	200.000	198.886,00	0,20
ABANCA CORPORACION B FL.R 23-33 23/09A	EUR	100.000	100.093,00	0,10
BANCO DE BADELL FL.R 23-29 07/02A	EUR	100.000	98.110,50	0,10
BANCO DE BADELL FL.R 23-29 07/06A	EUR	100.000	99.797,00	0,10
BANCO DE BADELL FL.R 23-33 16/08A	EUR	200.000	185.005,00	0,18
BANCO DE SABADELL SA FL.R 18-28 12/12A	EUR	100.000	99.961,50	0,10
BANCO DE SABADELL SA FL.R 19-25 07/11A	EUR	200.000	189.211,00	0,19
BANCO NTANDER FL.R 23-33 23/08A	EUR	200.000	198.798,00	0,20

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
BANCO SANTANDER SA FL.R 18-XX 19/03Q	EUR	200.000	172.482,00	0,17
BBVA FL.R 18-XX 24/03Q	EUR	400.000	396.974,00	0,39
BBVA FL.R 20-XX 15/10Q	EUR	200.000	188.326,00	0,19
BBVA FL.R 23-XX 21/09Q	EUR	200.000	199.443,00	0,20
CAIXABANK FL.R 23-27 16/05A	EUR	200.000	198.272,00	0,20
CAIXABANK SA FL.R 23-33 25/10S	GBP	200.000	217.797,58	0,21
CAIXABANK SA FL.R 23-34 30/05A	EUR	200.000	198.513,00	0,20
CAIXABANK SUB FL.R 17-XX 13/06A	EUR	200.000	194.104,00	0,19
IBERCAJA FL.R 23-27 07/06A	EUR	200.000	199.467,00	0,20
IBERCAJA FL.R 23-XX 25/04Q	EUR	200.000	188.315,00	0,19
UNICAJA BANCO SA FL.R 23-29 21/02A	EUR	300.000	290.452,50	0,29
<b>Svezia</b>			<b>383.650,93</b>	<b>0,38</b>
SKANDINAVISKA ENSKIL FL.R 23-25 13/06Q	EUR	100.000	100.085,00	0,10
SWEDBANK AB FL.R 23-XX 17/03S	USD	200.000	169.037,58	0,17
VATTENFALL AB FL.R 23-83 17/08A	GBP	100.000	114.528,35	0,11
<b>Svizzera</b>			<b>653.628,06</b>	<b>0,64</b>
UBS GROUP FUNDING FL.R 19-99 31/07S	USD	300.000	266.362,06	0,26
UBS GROUP SA FL.R 18-25 17/04A	EUR	400.000	387.266,00	0,38
<b>Regno Unito</b>			<b>1.979.348,50</b>	<b>1,95</b>
BARCLAYS PLC FL.R 19-XX 15/03Q	GBP	400.000	403.724,29	0,40
BARCLAYS PLC FL.R 23-99 31/12Q	GBP	200.000	211.327,85	0,21
HSBC HOLDINGS P FL.R 23-34 20/06S	USD	200.000	182.289,64	0,18
LLOYDS BANKING GROUP FL.R 23-XX 27/06Q	USD	200.000	167.251,14	0,16
NATWEST GROUP FL.R 23-28 14/03A	EUR	170.000	169.206,95	0,17
NATWEST GROUP FL.R 23-29 16/02A	EUR	130.000	128.246,30	0,13
NATWEST GROUP PLC FL.R 18-25 04/03A	EUR	300.000	294.528,00	0,29
NATWEST GROUP PLC FL.R 23-34 28/02A	EUR	120.000	118.747,80	0,12
THE COOPERATIVE BANK FL.R 23-28 24/05S	GBP	140.000	162.876,53	0,16
VIRGIN MONEY UK FL.R 23-28 29/10A	EUR	150.000	141.150,00	0,14
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>410.531,80</b>	<b>0,40</b>
BBVA BANCOMER SA FL.R 18-33 18/01S	USD	300.000	240.834,55	0,24
LIBERTY MUTUAL GROUP FL.R 19-59 23/05A	EUR	100.000	95.312,50	0,09
SANTANDER HOLDINGS U FL.R 23-29 09/03S	USD	82.000	74.384,75	0,07
<b>Obbligazioni convertibili</b>			<b>83.319,50</b>	<b>0,08</b>
<b>Svezia</b>			<b>83.319,50</b>	<b>0,08</b>
FAST AB CV 3.5 23-28 23/02Q	EUR	100.000	83.319,50	0,08
<b>Organismi di investimento collettivo</b>			<b>4.127.522,85</b>	<b>4,06</b>
<b>Azioni/quote di fondi di investimento</b>			<b>4.127.522,85</b>	<b>4,06</b>
<b>Irlanda</b>			<b>1.566.916,64</b>	<b>1,54</b>
INVESCO MARKETS II PLC - INVESCO COINSHARES GLOBAL BLOCKCHAIN UCITS ETF	GBP	5.144	303.341,05	0,30
INVESCO MARKETS PLC - INVESCO MORNINGSTAR US ENERGY INFRASTRUCTURE MLP UCITS ETF	USD	5.647	221.920,38	0,22
ISHARES IV PLC - ISHARES AUTOMATION & ROBOTICS UCITS ETF	EUR	75.669	828.726,89	0,82
XTRACKERS (IE) PLC - XTRACKERS S&P 500 EQUAL WEIGHT UCITS ETF	USD	2.912	212.928,32	0,21
<b>Lussemburgo</b>			<b>2.560.606,21</b>	<b>2,52</b>
AMUNDI INDEX SOLUTIONS SICAV - AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR -UCITS ETF-	EUR	9.313	932.045,04	0,92
AMUNDI INDEX SOLUTIONS SICAV - AMUNDI STOXX AI GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE -UCITS ETF C-	EUR	12.296	1.009.329,46	0,99
LYXOR COMMODITIES THOMSON REUTERS CORECO	USD	29.893	619.231,71	0,61
<b>Totale portafoglio titoli</b>			<b>90.861.234,37</b>	<b>89,42</b>
<b>Depositi bancari/(saldi passivi)</b>			<b>9.785.479,94</b>	<b>9,63</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>			<b>969.382,85</b>	<b>0,95</b>
<b>Totale attività nette</b>			<b>101.616.097,16</b>	<b>100,00</b>

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

---

### Ripartizione geografica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Paese</b>	<b>% delle attività nette</b>
Italia	9,92
Francia	8,45
Stati Uniti d'America	8,15
Irlanda	6,39
Regno Unito	5,37
Paesi Bassi	5,27
Spagna	4,59
Germania	4,12
Lussemburgo	3,65
Belgio	3,55
Messico	3,51
Jersey	2,78
Svizzera	2,66
Giappone	2,65
Canada	2,02
Brasile	2,00
Svezia	1,58
Romania	1,45
Colombia	1,03
Indonesia	0,98
Austria	0,90
Danimarca	0,80
Polonia	0,77
Isole Cayman	0,68
Cile	0,55
Finlandia	0,52
Australia	0,47
Grecia	0,45
Repubblica Ceca	0,45
Bulgaria	0,39
Albania	0,39
Sudafrica	0,38
Ungheria	0,31
Qatar	0,30
Portogallo	0,30
Nuova Zelanda	0,25
Perù	0,24
Bermuda	0,19
Panama	0,19
India	0,18
Islanda	0,12
Repubblica Dominicana	0,12
Macedonia	0,10
Isola di Man	0,10
Malta	0,10
Filippine	0,05
<b>Totale</b>	<b>89,42</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>10,58</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>



## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

---

### Ripartizione economica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

Settore	% delle attività nette
Banche e altre istituzioni finanziarie	21,86
Holding e società finanziarie	16,28
Obbligazioni di Stati, province e comuni	16,15
Fondi di investimento	4,06
Internet e servizi Internet	3,28
Organizzazioni sovranazionali	2,82
Trasporto	2,66
Servizi di pubblica utilità	1,98
Comunicazioni	1,78
Petrolio	1,73
Alberghi e ristoranti	1,66
Ingegneria elettrica ed elettronica	1,53
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	1,40
Veicoli stradali	1,24
Assicurazione	1,04
Prodotti farmaceutici e cosmetici	0,91
Società immobiliari	0,90
Tessile e abbigliamento	0,85
Prodotti chimici	0,74
Elettronica e semiconduttori	0,69
Costruzione di macchine e apparecchi	0,69
Servizi vari	0,67
Materiali per l'edilizia e commercio	0,59
Imballaggi	0,50
Forniture per ufficio e informatica	0,40
Agricoltura e pesca	0,39
Tabacco e bevande alcoliche	0,35
Pneumatici e gomma	0,35
Metalli non ferrosi	0,30
Arti grafiche ed editoria	0,30
Servizi sanitari e sociali	0,27
Carta e prodotti forestali	0,21
Miniere di carbone e industria siderurgica	0,20
Cibi e bevande non alcoliche	0,20
Istituzioni non classificabili/non classificate	0,18
Metalli e pietre preziose	0,16
Beni di consumo vari	0,10
<b>Totale</b>	<b>89,42</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>10,58</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible  
Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)**

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>374.944.523,34</b>
Portafoglio titoli a valore di mercato	2b	318.333.585,22
<i>Prezzo di costo</i>	2f	320.974.915,97
Opzioni (posizioni lunghe) a valore di mercato	2b	1.010.868,52
<i>Opzioni acquistate al costo</i>	2f	1.721.277,31
Depositi bancari		42.928.944,44
Credito per garanzia	10	260.000,00
Credito a fronte cessione investimenti		4.163.946,56
Sottoscrizioni da incassare		2.128.651,44
Plusvalenza netta non realizzata su swap	2b	2.223.893,60
Dividendi da incassare, netti	2c	87.999,60
Interessi da incassare, netti	2c	3.753.931,87
Oneri di costituzione, netti	2i	33.507,90
Altri asset		19.194,19
<b>Passività</b>		<b>20.284.403,98</b>
Opzioni (posizioni corte) a valore di mercato	2b	2.690.268,00
<i>Opzioni vendute al costo</i>	2f	1.842.481,02
Scoperti bancari		304.037,34
Garanzie da versare	10	3.690.000,00
Debiti su investimenti acquistati		8.871.541,78
Debiti per riscatti		1.131.139,63
Minusvalenza netta non realizzata su contratti forward sui cambi	2b	392.759,59
Minusvalenza netta non realizzata su futures finanziari	2b	1.513.675,39
Commissioni di gestione dovute	3	815.686,94
Commissioni dovute a Depositario, Amministrazione Centrale e Agenti per il pagamento	4.5	180.679,20
Imposta di sottoscrizione dovuta ("Taxe d'abonnement")	9	36.328,73
Interessi da corrispondere, netti		554.561,26
Debiti su cambi		16.497,46
Altre passività		87.228,66
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>354.660.119,36</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Conto economico e variazioni delle attività nette dal 28/09/22 al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Proventi</b>		<b>6.067.041,36</b>
Dividendi netti	2c	659.158,12
Interessi netti su obbligazioni	2c	3.055.869,66
Interessi ricevuti su swap		1.920.468,47
Interessi bancari sui conti correnti		320.000,43
Altri proventi		111.544,68
<b>Oneri</b>		<b>2.950.174,08</b>
Commissioni di gestione e di consulenza	3	1.400.358,53
Commissioni del Depositario, dell'Amministrazione Centrale e degli Agenti per il pagamento	4,5	306.022,88
Ammortamento degli oneri di costituzione	2i	10.768,52
Commissioni di transazione	6	326.457,69
Imposta di sottoscrizione ("Taxe d'abonnement")	9	67.588,50
Interessi bancari sugli scoperti		20.458,89
Interessi pagati su swap		711.913,53
Altri oneri	2g	106.605,54
<b>Utile / (perdita) netto(a) da investimenti</b>		<b>3.116.867,28</b>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
- vendite di portafoglio titoli	2d	-784.599,14
- opzioni	2b	323.034,88
- contratti di cambio a termine	2b	362.371,55
- futures finanziari	2b	1.694.852,03
- swap	2b	-1.209.363,34
- cambi	2h	-1.124.932,04
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a)</b>		<b>2.378.231,22</b>
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
- portafoglio titoli	2b	-2.641.330,75
- opzioni	2b	-1.558.195,77
- contratti di cambio a termine	2b	-392.759,59
- futures finanziari	2b	-1.513.675,39
- swap	2b	2.223.893,60
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette a seguito delle operazioni</b>		<b>-1.503.836,68</b>
Dividendi distribuiti	7	-784.223,79
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		356.948.179,83
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>354.660.119,36</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>354.660.119,36</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Informazioni statistiche

		<b>30/06/23</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>354.660.119,36</b>
<b>A - EUR</b>		
Numero di azioni		1.056.062,901
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,39
<b>AD - EUR</b>		
Numero di azioni		968.518,429
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,39
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		237.660,070
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,19
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		226.391,154
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,18
<b>M - EUR</b>		
Numero di azioni		25.729,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,45
<b>MD - EUR</b>		
Numero di azioni		205.029,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,43
<b>O - EUR</b>		
Numero di azioni		10.262,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,71
<b>OD - EUR</b>		
Numero di azioni		17.549,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,40
<b>U - EUR</b>		
Numero di azioni		2.406,762
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	99,78
<b>UD - EUR</b>		
Numero di azioni		861,331
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	99,95
<b>E - EUR</b>		
Numero di azioni		450.286,755
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	101,35
<b>EFQD - EUR</b>		
Numero di azioni		338.728,625
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	97,39

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Valori mobiliari ammessi alla quotazione ufficiale in una borsa valori e/o negoziati su un altro mercato regolamentato</b>			<b>313.491.174,69</b>	<b>88,39</b>
<b>Azioni</b>			<b>60.316.182,72</b>	<b>17,01</b>
<b>Australia</b>			<b>188.056,65</b>	<b>0,05</b>
BHP GROUP LTD	GBP	2.260	61.625,59	0,02
TRANSURBAN GROUP	AUD	12.850	111.722,09	0,03
WOODSIDE ENERGY AZIONI	AUD	700	14.708,97	0,00
<b>Belgio</b>			<b>1.000.383,26</b>	<b>0,28</b>
ANHEUSER-BUSCH INBEV	EUR	12.762	661.454,46	0,19
UCB	EUR	4.174	338.928,80	0,10
<b>Brasile</b>			<b>107.115,95</b>	<b>0,03</b>
PETROLEO BRASILEIRO SP.ADR REPR.2 SH	USD	8.450	107.115,95	0,03
<b>Canada</b>			<b>1.203.330,32</b>	<b>0,34</b>
AGNICO EAGLE MINES LTD	USD	14.679	672.462,35	0,19
BARRICK GOLD CORPORATION	USD	4.300	66.726,86	0,02
CAMECO CORP	USD	5.900	169.428,96	0,05
CANFOR CORPORATION (NEW)	CAD	2.600	42.826,07	0,01
FRANCO NEVADA CORP	USD	463	60.516,77	0,02
NUTRIEN - AZIONE NOMINATIVA	USD	950	51.418,42	0,01
PAN AMERICAN SILVER	USD	4.099	54.778,57	0,02
WHEATON PRECIOUS METAL - AZIONI NOMINATIVE	USD	2.150	85.172,32	0,02
<b>Cile</b>			<b>33.281,39</b>	<b>0,01</b>
SOQUIMICH SPONSORED ADR REPR 1 -B- PRIV	USD	500	33.281,39	0,01
<b>Cina</b>			<b>45.199,25</b>	<b>0,01</b>
BEIJING CAP. INTERNATIONAL AIRPORT -H-	HKD	48.000	28.464,16	0,01
GANFENG LIT GRP -PREFERENTIAL SHARE -H-	HKD	2.800	16.735,09	0,00
<b>Curacao</b>			<b>224.934,48</b>	<b>0,06</b>
SLB	USD	4.996	224.934,48	0,06
<b>Danimarca</b>			<b>1.720.297,79</b>	<b>0,49</b>
NOVO NORDISK	DKK	9.077	1.340.225,73	0,38
ORSTED	DKK	650	56.288,32	0,02
VESTAS WIND SYSTEMS - BEARER AND/OR SHS	DKK	13.286	323.783,74	0,09
<b>Finlandia</b>			<b>126.753,50</b>	<b>0,04</b>
NESTE	EUR	1.700	59.942,00	0,02
UPM KYMMENE CORP	EUR	2.450	66.811,50	0,02
<b>Francia</b>			<b>6.420.935,90</b>	<b>1,81</b>
ACCOR SA	EUR	12.830	436.476,60	0,12
AIR LIQUIDE SA	EUR	8.286	1.360.561,20	0,38
ALSTOM	EUR	1.900	51.908,00	0,01
AXA SA	EUR	13.246	357.973,15	0,10
BOUYGUES SA	EUR	2.100	64.596,00	0,02
CIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	1.200	66.876,00	0,02
COVIVIO SA	EUR	1.250	53.975,00	0,02
DANONE SA	EUR	850	47.719,00	0,01
DASSAULT SYST.	EUR	19.409	788.490,63	0,22
ENGIE SA	EUR	4.950	75.378,60	0,02
GECINA	EUR	800	78.040,00	0,02
KERING	EUR	462	233.587,20	0,07
L'OREAL SA	EUR	725	309.647,50	0,09
LVMH	EUR	627	541.101,00	0,15
SANOFI	EUR	5.330	523.406,00	0,15
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	2.647	440.619,62	0,12

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
TOTALENERGIES SE	EUR	10.552	554.507,60	0,16
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	2.900	83.955,00	0,02
VINCI SA	EUR	3.310	352.117,80	0,10
<b>Germania</b>			<b>4.516.608,86</b>	<b>1,27</b>
ADIDAS AG NAMEN AKT	EUR	2.578	458.316,84	0,13
DEUTSCHE BOERSE AG REG SHS	EUR	6.138	1.037.935,80	0,29
DEUTSCHE POST AG REG SHS	EUR	2.450	109.588,50	0,03
FRAPORT AG	EUR	1.700	83.062,00	0,02
FRESENIUS SE	EUR	1.700	43.129,00	0,01
INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	EUR	12.440	470.045,40	0,13
KWS SAAT SE & CO KGAA	EUR	150	8.445,00	0,00
LEG IMMOBILIEN - NAMEN AKT	EUR	750	39.480,00	0,01
MERCK KGAA	EUR	3.414	517.391,70	0,15
RWE AG	EUR	2.050	81.733,50	0,02
SAP AG	EUR	2.920	365.408,80	0,10
SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE	EUR	5.163	787.564,02	0,22
SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	EUR	24.285	392.931,30	0,11
SUEDZUCKER AG	EUR	3.500	57.155,00	0,02
VONOVIA SE	EUR	3.600	64.422,00	0,02
<b>Hong Kong</b>			<b>22.138,79</b>	<b>0,01</b>
GUANGDONG INVEST -RC-	HKD	28.000	22.138,79	0,01
<b>Irlanda</b>			<b>2.679.707,09</b>	<b>0,76</b>
CRH PLC	EUR	8.213	414.756,50	0,12
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	USD	1.108	204.233,55	0,06
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	GBP	2.552	469.866,57	0,13
JOHNSON CONTROLS INTL	USD	2.723	170.068,95	0,05
KERRY GROUP -A-	EUR	10.636	950.645,68	0,27
MEDTRONIC HLD	USD	5.822	470.135,84	0,13
<b>Italia</b>			<b>3.173.431,15</b>	<b>0,89</b>
ENEL SPA	EUR	217.152	1.339.393,54	0,38
ENI SPA	EUR	8.150	107.433,30	0,03
FERRARI	EUR	1.623	486.088,50	0,14
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	EUR	4.550	54.964,00	0,02
PRYSMIAN SPA	EUR	7.567	289.664,76	0,08
SNAM SPA	EUR	187.150	895.887,05	0,25
<b>Giappone</b>			<b>60.631,24</b>	<b>0,02</b>
FANUC CORP SHS	JPY	1.900	60.631,24	0,02
<b>Paesi Bassi</b>			<b>2.889.034,46</b>	<b>0,81</b>
AERCAP HOLDINGS	USD	3.009	175.189,44	0,05
AIRBUS SE	EUR	2.945	389.800,20	0,11
ASML HOLDING NV	EUR	1.359	901.017,00	0,25
EURONEXT NV	EUR	6.144	382.771,20	0,11
ING GROUP NV	EUR	27.930	344.600,34	0,10
KONINKLIJKE KPN NV	EUR	212.804	695.656,28	0,20
<b>Norvegia</b>			<b>238.387,65</b>	<b>0,07</b>
AUSTEVOLL SEAFOOD	NOK	7.550	47.896,01	0,01
EQUINOR ASA	NOK	2.775	74.096,55	0,02
LEROF SEAFOOD GROUP ASA	NOK	3.650	12.715,75	0,00
MOWI ASA	NOK	3.780	55.041,79	0,02
YARA INTERNATIONAL ASA	NOK	1.500	48.637,55	0,01
<b>Portogallo</b>			<b>52.369,20</b>	<b>0,01</b>
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA - REG.SHS	EUR	11.700	52.369,20	0,01

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Sudafrica</b>			<b>20.590,28</b>	<b>0,01</b>
SIBANYE STILLW - SHS ADR	USD	3.600	20.590,28	0,01
<b>Spagna</b>			<b>1.875.541,01</b>	<b>0,53</b>
ACS	EUR	1.100	35.387,00	0,01
BANCO SANTANDER SA REG SHS	EUR	104.036	352.161,86	0,10
CELLNEX TELECOM SA	EUR	1.700	62.883,00	0,02
IBERDROLA SA	EUR	69.773	833.787,35	0,24
INDITEX SHARE FROM SPLIT	EUR	13.755	487.752,30	0,14
MELIA HOTELS	EUR	3.400	21.590,00	0,01
REPSOL SA	EUR	6.150	81.979,50	0,02
<b>Svezia</b>			<b>368.223,20</b>	<b>0,10</b>
ATLAS COPCO AB -A-	SEK	27.923	368.223,20	0,10
<b>Svizzera</b>			<b>6.353.219,00</b>	<b>1,79</b>
CHUBB - NAMEN AKT	USD	1.950	344.172,32	0,10
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	CHF	2.429	377.396,50	0,11
DSM FIRMENICH	EUR	7.503	739.945,86	0,21
HOLCIM LTD	CHF	840	51.808,82	0,01
LONZA GROUP	CHF	1.876	1.025.212,23	0,29
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	CHF	14.751	1.626.153,99	0,46
ROCHE HOLDING LTD	CHF	6.273	1.757.763,95	0,50
SCHINDLER HOLDING SA	CHF	2.005	430.765,33	0,12
<b>Regno Unito</b>			<b>8.461.269,88</b>	<b>2,39</b>
ANGLO AMERICAN PLC	GBP	1.700	44.235,86	0,01
ASTRAZENECA PLC	GBP	11.566	1.519.760,14	0,43
DIAGEO PLC	GBP	16.233	639.180,88	0,18
FRESNILLO PLC	GBP	6.800	48.352,39	0,01
LLOYDS BANKING GROUP PLC	GBP	969.074	492.244,20	0,14
NATIONAL GRID PLC	GBP	3.400	41.224,73	0,01
PENNON GROUP --- REGISTERED SHS	GBP	4.250	35.212,38	0,01
PRUDENTIAL PLC	GBP	49.808	643.385,98	0,18
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GBP	16.073	1.107.307,30	0,31
SEGRO (REIT)	GBP	5.150	43.017,19	0,01
SHELL PLC	GBP	46.752	1.277.060,58	0,36
SMITH AND NEPHEW PLC	GBP	34.107	503.964,06	0,14
SMITHS GROUP -SHS-	GBP	12.513	239.717,67	0,07
UNILEVER	EUR	14.422	688.073,62	0,19
VODAFONE GROUP PLC	GBP	1.320.849	1.138.532,90	0,32
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>18.534.742,42</b>	<b>5,23</b>
ADOBE INC	USD	1.208	541.429,81	0,15
ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	6.315	659.341,57	0,19
AES CORP	USD	2.050	38.951,88	0,01
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	USD	200	54.909,26	0,02
ALBEMARLE - REGISTERED SHS	USD	90	18.403,39	0,01
ALEXANDRIA REAL ESTATE	USD	550	57.213,11	0,02
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	USD	825	143.630,16	0,04
ALPHABET INC -C-	USD	7.480	829.381,85	0,23
AMERICAN WATER WORKS CO INC	USD	300	39.252,98	0,01
AMERESCO INC	USD	750	33.430,34	0,01
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	USD	6.255	482.741,52	0,14
AMERICAN HOMES 4 RENT	USD	1.400	45.490,38	0,01
AMERICAN TOWER CORP	USD	3.308	588.041,72	0,17
AMRICLD RLTYTST -SHS OF BENEF INTEREST	USD	2.050	60.692,03	0,02
APPLE INC	USD	1.290	229.350,41	0,06
AQUA AMERICA --- REGISTERED SHS	USD	900	32.923,01	0,01
AT&T INC	USD	35.678	521.598,63	0,15

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*



## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
AUTODESK INC	USD	1.353	253.746,41	0,07
AVALONBAY COMMUN	USD	650	112.763,98	0,03
AVERY DENNISON CORP	USD	300	47.241,06	0,01
BAKER HUGHES RG-A REGISTERED SHS -A-	USD	12.810	371.149,50	0,10
BANK OF NY MELLON	USD	13.792	562.804,62	0,16
BOSTON SCIENTIF CORP	USD	10.711	531.033,90	0,15
CDW	USD	1.084	182.322,64	0,05
CENTENE CORP	USD	4.669	288.656,32	0,08
CHEVRON CORP	USD	490	70.670,49	0,02
CME GROUP -A-	USD	1.717	291.606,72	0,08
COCA-COLA CO	USD	11.343	626.100,33	0,18
COMCAST CORP	USD	10.983	418.280,16	0,12
CORTEVA - REGISTERED SHS	USD	1.400	73.528,87	0,02
DANAHER CORP	USD	1.748	384.527,96	0,11
DIGITAL REALTY TRUST INC	USD	650	67.841,89	0,02
EQUINIX INC	USD	125	89.818,97	0,03
ESSEX PROPERTY TRUST	USD	300	64.427,13	0,02
ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A-	USD	2.060	370.800,00	0,10
EXXON MOBIL CORP	USD	913	89.751,83	0,03
FMC CORP	USD	500	47.818,52	0,01
FREEMONT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	USD	3.102	113.730,52	0,03
GREEN PLAINS RENEW	USD	950	28.073,33	0,01
HOME DEPOT INC	USD	2.039	580.563,67	0,16
HP ENTERPRISE CO	USD	24.868	382.935,29	0,11
IBM CORP	USD	3.105	380.824,98	0,11
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	USD	4.746	491.913,55	0,14
INVITATION HOMES REGISTERED	USD	950	29.954,17	0,01
KINDER MORGAN INC	USD	6.000	94.702,11	0,03
LAS VEGAS SANDS CORP	USD	3.503	186.227,31	0,05
LINDSAY	USD	400	43.754,35	0,01
LIVENT CORPORATION	USD	1.750	43.998,63	0,01
LOUISIANA PACIFIC CORP.	USD	650	44.671,86	0,01
MERCK & CO INC	USD	6.027	637.447,78	0,18
META PLATFORMS INC A	USD	1.939	510.040,53	0,14
MICRON TECHNOLOGY INC	USD	3.421	197.891,21	0,06
MICROSOFT CORP	USD	2.325	725.715,40	0,20
MOSAIC	USD	1.600	51.329,06	0,01
MP MATERIALS CORP	USD	1.600	33.554,54	0,01
NATIONAL INSTRUMENTS CORP	USD	8.142	428.369,20	0,12
NEWMONT CORPORATION	USD	1.450	56.697,53	0,02
NEXTERA ENERGY	USD	5.173	351.820,90	0,10
ORGANON --- REGISTERED SHS	USD	6.376	121.617,38	0,03
PFIZER INC	USD	15.499	521.084,62	0,15
PROCTER & GAMBLE CO	USD	3.639	506.124,53	0,14
PROLOGIS	USD	650	73.060,95	0,02
PURE STORAGE -A-	USD	4.422	149.237,43	0,04
QUALCOMM INC	USD	500	54.555,45	0,02
RAYONIER REIT	USD	1.400	40.293,31	0,01
ROCKWELL AUTOMATION	USD	655	197.790,79	0,06
ROSS STORES INC	USD	1.762	181.093,55	0,05
SALESFORCE INC	USD	2.155	417.291,75	0,12
SIMON PROPERTY GROUP - NOMINATIVA	USD	700	74.093,49	0,02
STERICYCLE INC	USD	950	40.438,13	0,01
TERADYNE INC	USD	1.050	107.146,20	0,03
TJX COS INC	USD	2.238	173.932,19	0,05
ULTA BEAUTY RG PREFERENTIAL SHARE	USD	369	159.165,50	0,04
UNITED PARCEL SERVICE INC	USD	300	49.289,64	0,01
VISA INC -A-	USD	2.723	592.720,48	0,17

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
WALT DISNEY CO	USD	2.201	180.114,83	0,05
WEYERHAEUSER CO	USD	2.050	62.965,63	0,02
XCEL ENERGY INC	USD	650	37.039,87	0,01
XYLEM INC	USD	450	46.451,88	0,01
ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	USD	100	13.345,55	0,00
<b>Obbligazioni</b>			<b>236.113.227,15</b>	<b>66,57</b>
<b>Australia</b>			<b>176.650,00</b>	<b>0,05</b>
TELSTRA CORPORATION 1.375 19-29 26/03A	EUR	200.000	176.650,00	0,05
<b>Austria</b>			<b>187.324,00</b>	<b>0,05</b>
ERSTE GROUP BANK AG 1.5 22-26 07/04A	EUR	200.000	187.324,00	0,05
<b>Belgio</b>			<b>948.839,00</b>	<b>0,27</b>
ANHEUSER-BUSCH INBEV 2.00 16-28 17/03A	EUR	400.000	374.846,00	0,11
BELFIUS BANQUE SA/NV 3.125 16-26 11/05A	EUR	400.000	381.906,00	0,11
SOLVAY SA 2.75 15-27 02/12A	EUR	200.000	192.087,00	0,05
<b>Brasile</b>			<b>537.186,07</b>	<b>0,15</b>
BRAZIL 10.125 97-27 15/05S	USD	500.000	537.186,07	0,15
<b>Bulgaria</b>			<b>267.987,15</b>	<b>0,08</b>
BULGARIA 4.5 23-33 27/01A	EUR	270.000	267.987,15	0,08
<b>Isole Cayman</b>			<b>1.261.447,39</b>	<b>0,36</b>
AMERICAN AIRLINES 5.5 21-26 24/03Q	USD	250.000	226.507,80	0,06
AVOLON HLDG FUNDING 4.25 20-26 15/04SS	USD	328.000	280.080,74	0,08
COUNTRY GARDEN HLDG 3.125 20-25 22/10S	USD	200.000	58.242,90	0,02
MELCO RESORTS FINANCE 4.875 17-25 06/06S	USD	800.000	696.615,95	0,20
<b>Cile</b>			<b>1.101.171,86</b>	<b>0,31</b>
CHILE 4.34 22-42 07/03S	USD	1.350.000	1.101.171,86	0,31
<b>Colombia</b>			<b>733.541,43</b>	<b>0,21</b>
EMPR PU 4.25 19-29 18/07S	USD	1.010.000	733.541,43	0,21
<b>Croazia</b>			<b>1.008.874,43</b>	<b>0,28</b>
CROATIA 6.00 13-24 26/01S	USD	1.100.000	1.008.874,43	0,28
<b>Repubblica Ceca</b>			<b>391.219,52</b>	<b>0,11</b>
ENERGO-PRO AS 8.5 22-27 04/02S	USD	450.000	391.219,52	0,11
<b>Danimarca</b>			<b>400.030,00</b>	<b>0,11</b>
ORSTED 3.75 23-30 01/03A	EUR	400.000	400.030,00	0,11
<b>Repubblica Dominicana</b>			<b>655.909,35</b>	<b>0,18</b>
DOMINICAN REPUBLIC 7.45 14-44 30/04S	USD	730.000	655.909,35	0,18
<b>Egitto</b>			<b>159.714,00</b>	<b>0,05</b>
EGYPT 4.75 19-25 11/04A	EUR	200.000	159.714,00	0,05
<b>Finlandia</b>			<b>565.669,50</b>	<b>0,16</b>
NOKIA OYJ 2.00 19-26 11/03A	EUR	350.000	329.619,50	0,09
NOKIA OYJ 3.125 20-28 15/05A5A	EUR	250.000	236.050,00	0,07
<b>Francia</b>			<b>24.383.381,52</b>	<b>6,88</b>
ACCOR SA 2.375 21-28 29/11A	EUR	400.000	360.038,00	0,10
AEROPORTS DE PARIS-ADP- 1 17-27 13/12A	EUR	100.000	90.323,00	0,03
ARVAL SERVICE LEASE 3.375 22-26 04/01A	EUR	200.000	195.035,00	0,05
ARVAL SERVICE LEASE 4.125 23-26 13/04A	EUR	300.000	297.382,50	0,08
ARVAL SERVICE LEASE 4.75 22-27 22/05A	EUR	300.000	302.899,50	0,09
BFCM 1.25 20-25 05/12A	GBP	300.000	307.203,29	0,09
BFCM 3.875 23-28 26/01A	EUR	300.000	291.961,50	0,08
BFCM 4.375 23-30 02/05A	EUR	200.000	198.695,00	0,06
BNP PARIBAS SA 1.125 18-26 11/06A	EUR	150.000	138.015,75	0,04

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
BNP PARIBAS SA 1.25 18-25 19/03A	EUR	100.000	95.185,00	0,03
BNP PARIBAS SA 1.875 20-27 14/12A	GBP	300.000	285.509,53	0,08
BNP PARIBAS SA 2.375 15-25 17/02A	EUR	220.000	212.557,40	0,06
BNP PARIBAS SA 4.40 18-28 14/08S	USD	400.000	346.973,42	0,10
BPCE SA 1.375 20-26 23/12A	GBP	300.000	294.993,88	0,08
BPCE SA 3.50 17-27 23/10S	USD	500.000	415.733,28	0,12
BPCE SA 4.00 23-28 13/07A	EUR	400.000	397.292,00	0,11
CARREFOUR BQ 4.079 23-27 05/05A	EUR	200.000	196.940,00	0,06
CGG 7.75 21-27 01/04S	EUR	150.000	126.057,75	0,04
CIE SAINT GOBAIN 3.5 23-29 18/01A	EUR	200.000	196.546,00	0,06
CNP ASSURANCES 0.375 20-28 08/12A	EUR	200.000	164.768,00	0,05
CNP ASSURANCES 1.25 22-29 27/01A	EUR	300.000	248.605,50	0,07
CONSTELLUM SE 3.125 21-29 02/06S	EUR	203.000	171.773,53	0,05
CREDIT AGRICOLE SA 2.625 15-27 17/03A	EUR	200.000	187.111,00	0,05
CREDIT AGRICOLE SA 2 19-29 25/03AA	EUR	600.000	521.355,00	0,15
CREDIT AGRICOLE SA 3.375 22-27 28/07A	EUR	100.000	97.541,00	0,03
CREDIT AGRICOLE SA 4.125 23-30 07/03A	EUR	400.000	404.932,00	0,11
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.375 22-27 19/09A	EUR	200.000	194.425,00	0,05
DANONE SA 1.208 16-28 03/11A	EUR	500.000	442.810,00	0,12
DANONE SA 3.47 23-31 22/05A	EUR	100.000	99.616,00	0,03
EDENRED 3.625 23-31 13/06A	EUR	100.000	98.909,50	0,03
EDF SA 2.00 19-49 09/12A	EUR	500.000	301.732,50	0,09
EDF SA 6.25 08-28 30/05A	GBP	300.000	343.962,60	0,10
ELIS SA 2.875 18-26 15/02A	EUR	500.000	477.630,00	0,13
ENGIE SA 7.00 08-28 30/10A	GBP	200.000	241.482,26	0,07
EUTELSAT SA 2.0000 18-25 02/10A	EUR	100.000	90.758,50	0,03
FAURECIA 2.7500 21-27 15/02S	EUR	100.000	90.758,50	0,03
FNAC DARTY SA 2.625 19-26 30/05S	EUR	213.000	204.042,28	0,06
FORVIA 3.125 19-26 15/06S	EUR	255.000	240.468,83	0,07
FORVIA 7.25 22-26 15/06S	EUR	200.000	208.366,00	0,06
FRANCE 2.25 13-24 25/05A	EUR	570.000	563.789,85	0,16
FRANCE 4.50 09-41 25/04A	EUR	1.750.000	2.058.568,75	0,58
FRANCE 4.75 03-35 25/04A	EUR	550.000	642.191,00	0,18
FRANCE 5.5 97-29 25/04A	EUR	2.450.000	2.789.374,00	0,79
FRANCE 5.75 00-32 25/10A	EUR	550.000	676.502,75	0,19
FRANCE 6.00 94-25 25/10A	EUR	1.900.000	2.017.182,50	0,57
GECINA 1.375 17-28 26/01A	EUR	200.000	181.214,00	0,05
ILIAD HOLDING 5.625 21-28 15/10S	EUR	200.000	185.794,00	0,05
ILIAD SA 1.8750 18-25 25/04A	EUR	200.000	189.697,00	0,05
ILIAD SA 5.3750 22-27 14/06A	EUR	200.000	197.959,00	0,06
ILIAD SA 5.625 23-30 15/02A	EUR	400.000	388.146,00	0,11
LA BANQUE POSTALE 3 21-XX 20/05S	EUR	400.000	265.542,00	0,07
LA MONDIALE SOCIETE 0.75 20-26 20/10A	EUR	200.000	181.517,00	0,05
LOXAM SAS 2.875 19-26 15/04S	EUR	500.000	465.597,50	0,13
LVMH MOET HENNESSY 0.125 20-28 11/02A	EUR	500.000	434.992,50	0,12
ORANGE SA 1.375 18-28 20/03A	EUR	400.000	363.650,00	0,10
ORANGE SA 5.375 12-42 13/01S	USD	200.000	182.129,24	0,05
ORANGE SA 8.125 03-33 28/01AA	EUR	200.000	269.566,00	0,08
RCI BANQUE SA 0.5 22-25 14/07A	EUR	150.000	138.906,75	0,04
RCI BANQUE SA 4.5000 23-27 06/04A	EUR	400.000	392.922,00	0,11
RENAULT SA 2.5 21-28 01/04A	EUR	200.000	177.748,00	0,05
REXEL SA 2.125 21-28 15/06S	EUR	500.000	441.805,00	0,12
TOTALENERGIES CAPITAL 1.618 20-40 18/05A	EUR	200.000	145.595,00	0,04
TOTALENERGIES CAPITAL 2.5 14-26 25/03A	EUR	300.000	290.899,50	0,08
TOTALENERGIES CAPITAL 3.455 19-29 19/02S	USD	200.000	171.451,88	0,05
VALEO SA 3.25 14-24 22/01A	EUR	100.000	99.552,50	0,03
VEOLIA ENVIRONNEMENT 0 21-26 09/06U	EUR	600.000	537.678,00	0,15
VERALLIA SASU 1.625 21-28 14/05A	EUR	400.000	353.020,00	0,10

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Germania</b>			<b>50.429.634,91</b>	<b>14,22</b>
BAYER AG 0.375 21-29 12/01A	EUR	300.000	248.236,50	0,07
BAYER AG 4.25 23-29 26/08A	EUR	50.000	50.464,50	0,01
BOSCH GMBH ROBERT 3.625 23-30 02/06A	EUR	100.000	99.211,50	0,03
CHEPLAPHARM ARZNEIMI 4.375 20-28 15/10S	EUR	200.000	183.671,00	0,05
CONTINENTAL 4.0 23-28 01/06A	EUR	300.000	298.453,50	0,08
DEUTSCHE BAHN FIN 0.5 20-27 09/04A	EUR	397.000	356.595,32	0,10
DEUTSCHE BAHN FIN 0.75 20-35 16/07A/01A	EUR	300.000	220.722,00	0,06
DEUTSCHE BANK AG 2.625 19-26 12/02A	EUR	300.000	284.095,50	0,08
DEUTSCHE BANK AG 4.50 16-26 19/05A	EUR	100.000	98.034,50	0,03
DEUTSCHE BANK AG 4 22-27 29/11A	EUR	200.000	197.770,00	0,06
DEUTSCHE LUFTHANSA 2.875 21-25 11/02A	EUR	200.000	194.178,00	0,05
DEUTSCHE LUFTHANSA 2.875 21-27 16/05A	EUR	500.000	461.190,00	0,13
DEUTSCHE LUFTHANSA 3 20-26 29/05A	EUR	400.000	380.816,00	0,11
DEUTSCHE POST AG 1 20-32 20/05A	EUR	250.000	207.088,75	0,06
EVONIK INDUSTRIES 2.25 22-27 25/09A	EUR	400.000	373.832,00	0,11
GERMANY 0.00 20-25 10/10A	EUR	2.050.000	1.913.890,25	0,54
GERMANY 0.25 18-28 15/08A	EUR	2.520.000	2.249.679,60	0,63
GERMANY 0.5 18-28 15/02A	EUR	2.960.000	2.697.877,20	0,76
GERMANY 0 19-50 15/08A	EUR	2.650.000	1.427.475,50	0,40
GERMANIA 0 20-25 11/04U	EUR	3.650.000	3.452.516,75	0,97
GERMANIA 0 22-32 15/02A	EUR	3.950.000	3.233.667,50	0,91
GERMANY 1.00 15-25 15/08A	EUR	5.200.000	4.978.870,00	1,40
GERMANY 1.25 17-48 15/08A	EUR	5.600.000	4.453.932,00	1,26
GERMANY 1.7 22-32 15/08A	EUR	10.200.000	9.651.852,00	2,72
GERMANY 1.8 22-53 15/08A	EUR	5.050.000	4.421.350,75	1,25
GERMANY 2.2 23-28 13/04A	EUR	2.720.000	2.673.964,00	0,75
GERMANY 2.85 23-25 12/06A	EUR	1.950.000	1.935.745,50	0,55
GERMANY 4.75 08-40 04/07A	EUR	430.000	563.351,60	0,16
GERMANY 6.25 00-30 04/01A	EUR	150.000	184.033,50	0,05
GERMANY 6.25 94-24 04/01A5	EUR	150.000	152.034,75	0,04
GERMANY 6.5 97-27 04/07A	EUR	840.000	960.939,00	0,27
HENKEL AG AND CO 1.75 21-26 17/11A	USD	200.000	163.298,81	0,05
MAHLE GMBH 2.375 21-28 14/05A	EUR	200.000	151.543,00	0,04
NOVELIS SHEET INGOT 3.375 21-29 15/04S	EUR	206.000	181.765,13	0,05
RWE AG 4.125 23-35 13/02A	EUR	400.000	390.440,00	0,11
SCHAEFFLER AG 3.375 20-28 12/10A	EUR	200.000	183.056,00	0,05
THYSSENKRUPP AG 2.50 15-25 25/02S	EUR	200.000	195.291,00	0,06
VONOVIA SE 4.75 22-27 23/05A	EUR	100.000	98.206,50	0,03
ZF FINANCE GMBH 3.75 20-28 21/09A	EUR	300.000	270.499,50	0,08
ZF FINANCE GMBH 3 20-25 21/09A	EUR	200.000	189.996,00	0,05
<b>Guatemala</b>			<b>1.337.389,00</b>	<b>0,38</b>
GUATEMALA 4.90 19-30 01/06S	USD	1.560.000	1.337.389,00	0,38
<b>Hong Kong</b>			<b>1.287.801,56</b>	<b>0,36</b>
AIRPORT AUTHORITY 4.875 23-33 12/01S	USD	300.000	278.818,51	0,08
HONG KONG 4.625 23-33 11/01S	USD	200.000	189.046,75	0,05
LENOVO GROUP LTD 5.875 20-25 24/04S	USD	900.000	819.936,30	0,23
<b>Ungheria</b>			<b>4.704.635,30</b>	<b>1,33</b>
HUNGARY 5.375 14-24 25/03S	USD	280.000	255.911,27	0,07
HUNGARY 5.75 13-23 22/11S	USD	2.550.000	2.338.158,34	0,66
HUNGARY 6.75 11-28 22/10A	HUF	820.000.000	2.110.565,69	0,60
<b>Indonesia</b>			<b>7.166.669,97</b>	<b>2,02</b>
INDONESIA 4.125 15-25 15/01S	USD	1.250.000	1.129.537,13	0,32
INDONESIA 4.55 23-28 11/01S	USD	600.000	543.362,97	0,15
INDONESIA 4.85 23-33 11/01S	USD	430.000	393.972,22	0,11

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
INDONESIA 5.875 04-24 15/01S	USD	2.300.000	2.117.654,90	0,60
INDONESIA 7.75 08-38 17/01S	USD	1.130.000	1.298.588,54	0,37
INDONESIA 8.50 05-35 12/10S	USD	1.410.000	1.683.554,21	0,47
<b>Irlanda</b>			<b>14.243.647,37</b>	<b>4,02</b>
AERCAP IRELAND CAP 3 21-28 29/10S	USD	167.000	132.796,38	0,04
AMUNDI PHYSICAL METALS PLC - GOLD	USD	192.649	13.462.827,74	3,80
CRH FINANCE 1.375 16-28 18/10A	EUR	200.000	176.821,00	0,05
GE CAPITAL INTL 4.418 16-35 15/11S	USD	200.000	173.643,45	0,05
SMURFIT KAPPA 2.875 18-26 15/01S	EUR	308.000	297.558,80	0,08
<b>Israele</b>			-	<b>0,00</b>
<b>Italia</b>			<b>18.886.131,87</b>	<b>5,33</b>
AMPLIFON SPA 1.1250 20-27 13/02A	EUR	400.000	359.740,00	0,10
AUTOSTRADE ITALIA SPA 1.75 15-26 26/06A	EUR	200.000	185.053,00	0,05
AUTOSTRADE ITALIA SPA 2 20-28 08/03A	EUR	300.000	262.834,50	0,07
AUTOSTRADE ITALIA SPA 2 21-30 15/01A	EUR	200.000	168.394,00	0,05
AUTOSTRADE ITALIA SPA 5.125 23-33 14/06A	EUR	200.000	200.681,00	0,06
BANCO BPM SPA 1.75 19-25 28/01A	EUR	210.000	200.232,90	0,06
BANCO BPM SPA 4.875 23-27 18/01A	EUR	240.000	238.426,80	0,07
BANCO BPM SPA 6.00 23-28 14/06A	EUR	170.000	169.076,90	0,05
BANCO BPM SPA 6 22-26 13/09A	EUR	150.000	152.997,75	0,04
ENEL SPA 5.625 07-27 21/06A	EUR	300.000	321.931,50	0,09
ENI SPA 3.625 14-29 29/01A	EUR	300.000	295.095,00	0,08
ENI SPA 3.625 23-27 19/05A	EUR	300.000	295.338,00	0,08
ENI SPA 4.75 18-28 12/09S	USD	300.000	268.423,01	0,08
HERA SPA 4.25 23-33 20/04A	EUR	300.000	297.544,50	0,08
INFRA WIRELESS ITA 1.875 20-26 08/07A	EUR	300.000	279.180,00	0,08
INTESA SANPAOLO 2.3750 20-30 22/12A	EUR	500.000	378.927,50	0,11
INTESA SANPAOLO SPA 3.928 14-26 15/09AA	EUR	330.000	322.650,90	0,09
INTESA SANPAOLO SPA 4.75 22-27 06/09A	EUR	300.000	301.411,50	0,08
INTESA SANPAOLO SPA 4.875 23-30 19/05A	EUR	100.000	100.071,00	0,03
INTESA SANPAOLO SPA 5.625 23-33 08/03A	EUR	400.000	399.812,00	0,11
INTESA SANPAOLO SPA 6.50 23-29 14/03S	GBP	150.000	164.460,76	0,05
INTESA SANPAOLO SPA 6.625 13-23 13/09A	EUR	400.000	401.616,00	0,11
INTESA SANPAOLO SPA 6.625 23-33 20/06S	USD	200.000	182.330,89	0,05
INTESA SANPAOLO SPA 6.625 23-33 31/05S	GBP	100.000	111.978,09	0,03
IREN SPA 1.9500 18-25 19/09A	EUR	300.000	284.979,00	0,08
ITALIA 5.00 09-25 01/03S	EUR	2.900.000	2.952.997,50	0,83
ITALIA 5.00 09-40 01/09S	EUR	1.100.000	1.200.551,00	0,34
ITALIA 5 07-39 01/08S	EUR	570.000	619.869,30	0,17
ITALIA 6 99-31 01/05S	EUR	1.720.000	1.973.700,00	0,56
ITALIA 7.25 96-26 01/11S	EUR	2.760.000	3.062.427,00	0,86
ITALIA 9.00 93-23 01/11S	EUR	160.000	162.561,60	0,05
LEASYS SPA 0 21-24 22/07A	EUR	300.000	286.180,50	0,08
LEONARDO SPA 2.375 20-26 08/01A/07A	EUR	400.000	379.784,00	0,11
MEDIOBANCA 0.875 19-26 15/01A	EUR	100.000	92.380,50	0,03
MEDIOBANCA 1 20-27 08/09A8/09A	EUR	450.000	398.425,50	0,11
MEDIOBANCA 2.3000 20-30 23/11A	EUR	250.000	226.563,75	0,06
NEXI SPA 1.625 21-26 30/04S	EUR	327.000	298.810,96	0,08
NEXI SPA 2.125 21-29 30/04S/04S	EUR	150.000	125.296,50	0,04
PIRELLI C 4.25 23-28 18/01A	EUR	250.000	246.318,75	0,07
TELECOM ITALIA SPA 1.625 21-29 18/01A	EUR	150.000	115.550,25	0,03
TELECOM ITALIA SPA 3.625 16-24 19/01A	EUR	100.000	99.155,50	0,03
TELECOM ITALIA SPA 3 16-25 30/09A	EUR	100.000	94.533,50	0,03
UNICREDIT SPA 0.325 21-26 19/01A	EUR	229.000	207.839,26	0,06

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Costa d'Avorio</b>			<b>1.170.143,40</b>	<b>0,33</b>
IVORY COAST 5.25 18-30 22/03A	EUR	1.380.000	1.170.143,40	0,33
<b>Lussemburgo</b>			<b>619.632,32</b>	<b>0,17</b>
DANA FINANCING LUX 3 21-29 15/07S	EUR	243.000	198.216,32	0,06
HEIDELBERGCEMENT 1.125 19-27 01/12A	EUR	100.000	89.224,00	0,03
MEDTRONIC GLOBAL HLDG 1.375 20-40 15/10A	EUR	200.000	134.472,00	0,04
TRATON FINANCE LUX 4.00 23-25 16/09A	EUR	200.000	197.720,00	0,06
<b>Mauritius</b>			<b>368.904,12</b>	<b>0,10</b>
INDIA CLEANTECH 4.7 21-26 10/08S	USD	457.750	368.904,12	0,10
<b>Messico</b>			<b>8.211.981,10</b>	<b>2,32</b>
MEXICO 4.50 19-29 22/04S	USD	770.000	686.602,16	0,19
MEXICO 6.05 08-40 11/01S	USD	130.000	121.167,50	0,03
MEXICO 6.35 23-35 09/02S	USD	850.000	820.008,48	0,23
MEXICO 6.75 04-34 27/09S	USD	1.510.000	1.509.065,76	0,43
MEXICO 7.50 03-33 08/04S	USD	1.120.000	1.170.456,47	0,33
MEXICO 7.50 22-33 26/05S	MXN	450.000	2.218.687,20	0,63
MEXICO 8.30 01-31 15/08S	USD	400.000	432.918,42	0,12
PEMEX 10.0 23-33 07/02S	USD	240.000	201.429,51	0,06
PEMEX 6.49 20-27 23/01S	USD	1.290.000	1.051.645,60	0,30
<b>Marocco</b>			<b>377.928,51</b>	<b>0,11</b>
MOROCCO 6.5 23-33 08/09S	USD	400.000	377.928,51	0,11
<b>Paesi Bassi</b>			<b>12.214.959,33</b>	<b>3,44</b>
ABB FINANCE BV 3.25 23-27 16/01A	EUR	200.000	196.931,00	0,06
ABERTIS FINANCE BV 2.625 21-49 31/12A	EUR	300.000	250.065,00	0,07
ABN AMRO BANK NV 1.375 20-25 16/01S6/01S	GBP	100.000	108.150,09	0,03
ABN AMRO BANK NV 2.375 22-27 01/06A	EUR	200.000	186.794,00	0,05
ABN AMRO BANK NV 4.8 16-26 18/04S	USD	200.000	175.114,58	0,05
ABN AMRO BANK NV 4 23-28 16/01A	EUR	400.000	392.622,00	0,11
ASHLAND SERVICES BV 2.00 20-28 30/01S	EUR	150.000	127.533,75	0,04
BAYER CAPITAL CORP 1.5 18-26 26/06A6/06A	EUR	300.000	279.030,00	0,08
BMW FINANCE NV 0.2 21-33 11/01A	EUR	100.000	74.122,00	0,02
BMW FINANCE NV 3.25 23-26 22/11A	EUR	150.000	148.084,50	0,04
BMW FINANCE NV 3.625 23-35 22/05A	EUR	600.000	600.576,00	0,17
COCA COLA HBC FIN 2.75 22-25 23/09A3/09A	EUR	300.000	292.875,00	0,08
CRH FUNDING B.V. 1.625 20-30 05/05A	EUR	300.000	263.445,00	0,07
DAIMLER TRUCK INTL F 3.875 23-29 19/06A	EUR	300.000	297.432,00	0,08
DEUTSCHE TEL INTL FIN 7.5 03-33 24/01A	EUR	300.000	392.206,50	0,11
DEUT TELEKOM INT FIN 1.50 16-28 03/04A	EUR	400.000	363.352,00	0,10
DEUT TELEKOM INT FIN 9.25 02-32 01/06S	USD	200.000	233.346,47	0,07
EDP FINANCE BV 1.625 18-26 26/01A	EUR	201.000	190.183,18	0,05
ENBW INTL FINANCE 3.625 22-26 22/11A	EUR	300.000	298.360,50	0,08
ENEL FINANCE INTL 1.5 19-25 21/07A	EUR	150.000	142.891,50	0,04
ENEL FINANCE INTL 3.875 22-29 09/03A	EUR	400.000	399.710,00	0,11
ENEL FINANCE INTL 5.625 09-24 14/08A	GBP	239.000	276.498,06	0,08
ENEL FINANCE INTL 7.50 22-32 14/10S	USD	400.000	406.416,13	0,11
GOODYEAR EUROPE BV 2.75 21-28 15/08S	EUR	254.000	214.586,82	0,06
HEINEKEN NV 1.75 20-40 07/05A	EUR	250.000	185.733,75	0,05
KPN NV 1.125 16-28 11/09A	EUR	400.000	351.306,00	0,10
LEASEPLAN CORPORATION 0.25 21-26 23/02A	EUR	100.000	89.688,00	0,03
MERCEDESSENZ INTL FIN 1.5 16-26 09/03A	EUR	100.000	94.663,00	0,03
NATURGY FINANCE BV 1.25 16-26 19/04A	EUR	200.000	185.781,00	0,05
OCI NV 4.6250 20-25 15/10S	USD	400.000	350.595,79	0,10
RABOBANK 3.75 16-26 21/07S 16-26 21/07S	USD	321.000	274.680,08	0,08
REPSOL INTL FINANCE 0.25 19-27 02/08A	EUR	300.000	261.685,50	0,07
REPSOL INTL FINANCE 2.6250 20-30 15/04A	EUR	200.000	190.583,00	0,05

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
SAIPEM FIN INTL BV 3.125 21-28 31/03A	EUR	351.000	316.451,07	0,09
SAIPEM FIN INTL BV 3.375 20-26 15/07A	EUR	250.000	237.132,50	0,07
SAIPEM FIN INTL BV 3.75 16-23 08/09A	EUR	105.000	104.796,30	0,03
SHELL INTL FINANCE 0.75 16-28 15/08A	EUR	300.000	259.285,50	0,07
SHELL INTL FINANCE 2.50 14-26 24/03A	EUR	480.000	464.577,60	0,13
SHELL INTL FINANCE 2.75 20-30 06/04S	USD	400.000	327.827,69	0,09
SHELL INTL FINANCE 2.875 16-26 10/05SS	USD	400.000	349.340,05	0,10
SIEMENS FINANCIERING 0.5 19-34 05/09A	EUR	400.000	299.396,00	0,08
STELLANTIS NV 3.875 20-26 07/07A	EUR	150.000	149.161,50	0,04
STELLANTIS NV 4.2500 23-31 16/06A	EUR	100.000	98.603,50	0,03
STELLANTIS NV 4.5 20-28 07/07A	EUR	204.000	208.269,72	0,06
TELEFONICA EUROPE BV 8.25 00-30 15/09S	USD	130.000	137.913,20	0,04
UNIVERSAL MUSIC GRP 4.00 23-31 13/06A	EUR	100.000	99.818,00	0,03
VOLKSWAGEN INTL FIN 3.75 22-27 28/09A	EUR	300.000	293.523,00	0,08
VOLKSWAGEN INTL FIN 3.875 23-26 29/03A	EUR	100.000	98.597,00	0,03
VOLKSWAGEN INTL FIN 4.125 22-25 15/11A	EUR	200.000	198.764,00	0,06
WINTERSHALL DEA FIN 0.84 19-25 25/09A09A	EUR	300.000	276.460,50	0,08
<b>Nigeria</b>			<b>762.767,33</b>	<b>0,22</b>
NIGERIA 7.143 18-30 23/02S	USD	990.000	762.767,33	0,22
<b>Norvegia</b>			<b>309.026,61</b>	<b>0,09</b>
ADEVINTA ASA 2.625 20-25 05/11S	EUR	112.000	107.580,48	0,03
EQUINOR ASA 0.75 16-26 09/11A6-26 09/11A	EUR	222.000	201.446,13	0,06
<b>Oman</b>			<b>477.165,61</b>	<b>0,13</b>
NATIONAL BK OMAN 5.625 18-23 25/09S	USD	232.000	212.434,17	0,06
OMAN 6.75 18-48 17/01S	USD	300.000	264.731,44	0,07
<b>Panama</b>			<b>2.791.132,35</b>	<b>0,79</b>
PANAMA 6.70 06-36 26/01S	USD	350.000	343.896,66	0,10
PANAMA 6.853 23-54 28/03S	USD	200.000	191.187,90	0,05
PANAMA 7.125 05-26 29/01S	USD	800.000	766.115,49	0,22
PANAMA 8.875 97-27 30/09S	USD	250.000	263.092,34	0,07
PANAMA 9.375 99-29 01/04S	USD	1.110.000	1.226.839,96	0,35
<b>Filippine</b>			<b>3.292.231,46</b>	<b>0,93</b>
PHILIPPINES 10.625 00-25 16/03S	USD	1.750.000	1.758.324,94	0,50
PHILIPPINES 4.625 23-28 17/07S	USD	200.000	183.705,78	0,05
PHILIPPINES 5 23-33 17/07S	USD	400.000	371.642,53	0,10
PHILIPPINES 6.375 07-32 15/01S	USD	450.000	459.033,00	0,13
PHILIPPINES 9.50 05-30 02/02S	USD	450.000	519.525,21	0,15
<b>Polonia</b>			<b>1.281.801,96</b>	<b>0,36</b>
POLAND 4.875 23-33 04/10S	USD	400.000	360.516,96	0,10
POLAND 5.25 10-25 20/01A	EUR	900.000	921.285,00	0,26
<b>Portogallo</b>			<b>399.626,00</b>	<b>0,11</b>
ENERGIAS DE PORTUGAL 3.875 23-28 26/06A	EUR	400.000	399.626,00	0,11
<b>Qatar</b>			<b>1.065.881,76</b>	<b>0,30</b>
QATAR 5.103 18-48 23/04S	USD	900.000	823.792,85	0,23
QATAR 9.75 00-30 15/06S	USD	200.000	242.088,91	0,07
<b>Romania</b>			<b>3.156.269,23</b>	<b>0,89</b>
ROMANIA 4.875 14-24 22/01S	USD	1.500.000	1.368.829,06	0,39
ROMANIA 6.625 22-29 27/09A	EUR	860.000	895.032,10	0,25
ROMANIA 6.625 23-28 17/02S	USD	360.000	339.983,87	0,10
ROMANIA 6 22-34 25/05A	USD	360.000	328.428,23	0,09
ROMANIA 7.125 23-33 17/01S	USD	230.000	223.995,97	0,06

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Arabia Saudita</b>			<b>1.677.492,89</b>	<b>0,47</b>
SAUDI ARABIA 5.25 19-50 16/01S	USD	1.110.000	988.276,44	0,28
SAUDI ARABIA 5 23-53 18/01S	USD	810.000	689.216,45	0,19
<b>Sudafrica</b>			<b>2.464.033,44</b>	<b>0,69</b>
SOUTH AFRICA 8.00 13-30 31/01S	ZAR	30.480.000	1.306.581,91	0,37
SOUTH AFRICA 8.50 13-37 31/01S	ZAR	11.930.000	442.827,02	0,12
SOUTH AFRICA 8.875 15-35 28/02S	ZAR	17.970.000	714.624,51	0,20
<b>Spagna</b>			<b>10.163.333,18</b>	<b>2,87</b>
ABERTIS INFRASTRUCT 2.375 19-27 27/09A	EUR	300.000	280.900,50	0,08
AEDAS HOMES SAU 4 21-26 15/08S-26 21/05S	EUR	200.000	186.588,00	0,05
BANCO SABADELL 5.625 16-26 06/05A	EUR	100.000	99.515,00	0,03
BANCO SANTANDER SA 0.2 21-28 11/02A	EUR	300.000	251.437,50	0,07
BANCO SANTANDER SA 2.125 18-28 08/02A	EUR	400.000	359.680,00	0,10
BANCO SANTANDER SA 3.25 16-26 04/04A	EUR	200.000	193.083,00	0,05
BANCO SANTANDER SA 3.49 20-30 28/05S	USD	400.000	320.700,27	0,09
BANCO SANTANDER SA 3.875 23-28 16/01A	EUR	100.000	98.404,00	0,03
BANCO SANTANDER SA 5.125 23-30 25/01A	GBP	300.000	327.091,42	0,09
CAIXABANK SA 0.5 21-29 09/02A02A	EUR	100.000	83.133,00	0,02
CELLNEX FINANCE 1.0000 21-27 15/09A	EUR	500.000	430.830,00	0,12
CELLNEX TELECOM SA 1.75 20-30 23/10A	EUR	500.000	404.855,00	0,11
GRIFOLS SA 2.25 19-27 15/11S	EUR	392.000	355.963,44	0,10
INTERNATIONAL CONSOL 3.75 21-29 25/03A	EUR	500.000	437.697,50	0,12
INTL CONSO AIRLINE 2.75 21-25 25/03A03A	EUR	300.000	289.354,50	0,08
SANTANDER CONS FIN 0 21-26 23/02A	EUR	200.000	178.499,00	0,05
SPAIN 4.65 10-25 30/07A	EUR	1.050.000	1.075.725,00	0,30
SPAIN 4.80 08-24 31/01A	EUR	460.000	462.739,30	0,13
SPAIN 4.90 07-40 30/07A	EUR	170.000	195.920,75	0,06
SPAIN 5.15 13-44 31/10A	EUR	700.000	839.926,50	0,24
SPAIN 5.75 01-32 30/07A	EUR	870.000	1.036.561,50	0,29
SPAIN 5.90 11-26 30/07A	EUR	2.100.000	2.254.728,00	0,64
<b>Svezia</b>			<b>1.629.823,24</b>	<b>0,46</b>
INTRUM AB 3.00 19-27 15/09A	EUR	300.000	208.035,00	0,06
INTRUM AB 3.5000 19-26 15/07S	EUR	400.000	298.242,00	0,08
INTRUM AB 4.875 20-25 05/08S	EUR	239.000	198.704,60	0,06
SKANDINAVISKA ENSKIL 3.875 23-28 09/05A	EUR	100.000	98.961,00	0,03
VATTENFALL AB 3.75 22-26 18/10A26 18/10A	EUR	400.000	398.594,00	0,11
VOLVO CAR AB 2.125 19-24 02/04A	EUR	108.000	106.006,86	0,03
VOLVO CAR AB 2.5 20-27 07/10A	EUR	354.000	321.279,78	0,09
<b>Turchia</b>			<b>1.282.230,84</b>	<b>0,36</b>
TURKEY 9.875 22-28 15/01S	USD	1.370.000	1.282.230,84	0,36
<b>Emirati Arabi Uniti</b>			<b>1.189.893,68</b>	<b>0,34</b>
UNITED ARAB EMIRATES 4.0 20-50 28/07S	USD	1.400.000	825.615,04	0,23
UNITED ARAB EMIRATES 4.951 22-52 07/07S	USD	400.000	364.278,64	0,10
<b>Regno Unito</b>			<b>16.390.658,88</b>	<b>4,62</b>
ASTRAZENECA PLC 1.375 20-30 06/08S	USD	250.000	184.490,15	0,05
BARCLAYS PLC 1.125 21-31 22/03A	EUR	200.000	173.336,00	0,05
BARCLAYS PLC 3.25 16-27 12/02A	GBP	200.000	204.615,75	0,06
BP CAPITAL MARKETS 3.773 23-30 12/05A	EUR	150.000	148.126,50	0,04
COCA-COLA EURO PACIFIC 0.2 20-28 02/12A	EUR	500.000	415.295,00	0,12
CREDIT AGRICOLE LDN 3.125 14-26 05/02A	EUR	300.000	294.880,50	0,08
DIAGEO CAPITAL PLC 2.1250 20-32 29/04S	USD	200.000	149.332,73	0,04
DIAGEO CAPITAL PLC 5.20 22-25 24/10S	USD	200.000	183.762,60	0,05
DIAGEO FINANCE PLC 1.875 20-27 27/03A	EUR	300.000	282.447,00	0,08
HSBC HOLDINGS PLC 3.125 16-28 07/06A/06A	EUR	200.000	185.891,00	0,05

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*



## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
INEOS FINANCE PLC 3.375 20-26 29/10S	EUR	100.000	93.743,00	0,03
INTERCONTINENTA 3.3750 20-28 08/10A	GBP	200.000	198.044,63	0,06
INTL GAME TECHNOLOGY 2.375 19-28 15/04A	EUR	500.000	449.697,50	0,13
INTL GAME TECHNOLOGY 3.5 19-26 15/06S	EUR	220.000	212.815,90	0,06
ITV PLC 1.375 19-20 26/09A	EUR	200.000	182.463,00	0,05
LINDE PLC 0.3750 21-33 30/09A	EUR	200.000	146.159,00	0,04
LLOYDS BANK PLC 7.5 09-24 15/04S	GBP	234.000	274.895,12	0,08
NATIONAL GRID PLC 0.25 21-28 01/09A	EUR	400.000	331.976,00	0,09
NATWEST MARKETS PLC 0.8 21-24 12/05S	USD	200.000	172.779,10	0,05
NOMAD FOODS BONDCO 2.50 21-28 24/06S	EUR	150.000	132.052,50	0,04
PEARSON FUNDING FIVE 3.75 20-30 04/06A	GBP	200.000	198.112,22	0,06
ROLLS ROYCE PLC 1.625 18-28 09/05A	EUR	400.000	339.078,00	0,10
ROLLS-ROYCE PLC 4.625 20-26 21/10S	EUR	315.000	310.254,53	0,09
SANTANDER UK PLC 4 14-24 13/03S	USD	100.000	90.560,49	0,03
SKY LIMITED 2.25 15-25 17/11A5-25 17/11A	EUR	250.000	239.915,00	0,07
SKY LIMITED 2.5 14-26 15/09A	EUR	300.000	287.818,50	0,08
SYNTHOMER PLC 3.875 20-25 25/06S	EUR	100.000	92.733,50	0,03
TECHNIPFMC USD 6.5 21-26 01/02SS	USD	150.000	136.075,16	0,04
UBS ETC LKD TO BBG BRENT CRUDE TR	USD	769	678.249,54	0,19
UBS ETC LKD TO BBG EX-AGRI AND LIVESTOCK	USD	33.678	4.729.119,71	1,33
UBS ETC LKD TO BBG NATURAL GAS TR	USD	5.378	96.000,50	0,03
UBS ETC LKD TO UBS BBG CMCI ALUMINIUM	USD	3.935	214.242,90	0,06
UBS ETC LKD TO UBS BBG CMCI COPPER	USD	735	130.494,50	0,04
UBS ETC LKD TO UBS BBG CMCI HEATING	USD	4.440	480.219,98	0,14
REGNO UNITO 4.75 04-38 07/12S	GBP	950.000	1.138.361,59	0,32
REGNO UNITO 4.75 07-30 07/12S	GBP	900.000	1.072.889,35	0,30
REGNO UNITO 5.00 01-25 07/03S	GBP	850.000	986.129,76	0,28
REGNO UNITO 6.00 98-28 07/12S	GBP	500.000	617.901,88	0,17
VIRGIN MEDIA SEC FIN 5 17-27 15/04S	GBP	128.000	135.698,79	0,04
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>32.157.513,37</b>	<b>9,07</b>
7-ELEVEN INC 0.8 21-24 10/02S1-24 10/02S	USD	158.000	140.268,08	0,04
7-ELEVEN INC 1.3000 21-28 10/02S	USD	200.000	154.741,53	0,04
ABBVIE INC 3.20 20-29 21/11S	USD	400.000	331.184,23	0,09
ABBVIE INC 4.25 20-49 21/11S	USD	200.000	157.914,76	0,04
AB INBEV WORLDWIDE 4.35 20-40 01/06S	USD	200.000	168.417,05	0,05
AB INBEV WORLDWIDE 4 18-28 13/04S	USD	200.000	177.243,81	0,05
AIR LEASE CORP 3.1250 20-30 01/12S	USD	200.000	152.734,18	0,04
ALEXANDRIA REAL ESTATE 4.9 20-30 15/12SS	USD	150.000	133.145,28	0,04
ALLISON TRANSMISSION 5.875 19-29 01/06S	USD	100.000	89.437,67	0,03
AMAZON.COM INC 2.5 20-50 03/06S	USD	100.000	60.805,23	0,02
APPLE INC 3 17-27 20/06S	USD	300.000	260.324,93	0,07
AT&T INC 1.6 20-28 27/05A	EUR	300.000	268.978,50	0,08
AT&T INC 2.75 20-31 01/06S	USD	250.000	193.033,91	0,05
AT&T INC 3.15 17-36 04/09A	EUR	319.000	281.643,51	0,08
AVANTOR FUNDING INC 4.6250 20-28 15/07S	USD	100.000	85.103,12	0,02
BALL CORP 1.5000 19-27 15/03S	EUR	361.000	323.782,71	0,09
BALL CORP 2.8750 20-30 15/08S	USD	50.000	38.029,33	0,01
BALL CORP 5.25 15-25 01/07S	USD	304.000	275.802,67	0,08
BANK OF AMERICA CORP 3.384 22-26 02/04S	USD	200.000	175.890,92	0,05
BANK OF AMERICA CORP 4.2 14-24 26/08S	USD	228.000	205.138,35	0,06
BANK OF AMERICA CORP 6.11 07-37 29/01S	USD	211.000	203.945,71	0,06
BAYER US 3.375 14-24 08/10S	USD	200.000	177.597,61	0,05
BERKSHIRE HATHAWAY E 3.7 21-30 15/07S	USD	200.000	168.324,47	0,05
BEST BUY CO INC 1.95 20-30 01/10S	USD	250.000	184.393,91	0,05
BMW US CAPITAL LLC 4.1500 20-30 09/04S	USD	200.000	175.373,97	0,05
BOEING CO 2.196 21-26 04/02S	USD	400.000	336.494,96	0,09
BROADCOM INC 4.15 20-30 08/05S	USD	300.000	253.016,04	0,07

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
BROADCOM INC 4.15 22-32 15/04S	USD	200.000	166.045,83	0,05
BROADCOM INC 5 20-30 15/04S	USD	150.000	134.975,94	0,04
CCO HLDG LLC/CAPITAL 4.5 21-32 01/05S	USD	200.000	146.671,86	0,04
CENTENE CORP 4.2500 19-27 15/12S	USD	200.000	171.546,29	0,05
CITIGROUP INC 5.15 03-26 21/05A	GBP	353.000	398.203,25	0,11
COMCAST CORP 2.65 19-30 01/02S-30 01/02S	USD	200.000	160.421,63	0,05
CROWN AMERICAS 4.75 19-26 01/02S	USD	158.000	140.657,65	0,04
DELTA AIR LINES INC 7.375 20-26 12/06S	USD	216.000	206.586,88	0,06
ENERGY TRANSFER 3.75 20-30 15/05S	USD	250.000	206.993,59	0,06
ENERGY TRANSFER LP 2.9 20-25 15/05S	USD	300.000	260.945,01	0,07
ENI USA INC 7.3 97-27 15/11S	USD	500.000	490.130,62	0,14
ENLINK MIDSTREAM PART 5.625 20-28 15/01S	USD	100.000	88.997,71	0,03
ENTEGRIS U 4.375 20-28 15/04S	USD	100.000	84.081,57	0,02
FEDEX CORP 2.4 21-31 29/04S	USD	500.000	380.309,34	0,11
FORD MOTOR CREDIT CO 1.00 23-27 14/05A	EUR	100.000	102.754,50	0,03
FORD MOTOR CREDIT CO 3.375 20-25 13/11S	USD	200.000	170.536,20	0,05
FORD MOTOR CREDIT CO 4.867 23-27 03/08A	EUR	130.000	127.817,30	0,04
FORD MOTOR CREDIT CO 7.35 22-27 04/11S	USD	200.000	187.468,38	0,05
GENERAL MOTORS CO 6.8 20-27 01/10S	USD	400.000	380.900,09	0,11
GENERAL MOTORS FIN 0.6000 21-27 20/05A	EUR	400.000	345.066,00	0,10
GENERAL MOTORS FIN 0.85 20-26 26/02A	EUR	100.000	91.212,00	0,03
GENERAL MOTORS FIN 2.7 20-27 20/08S	USD	300.000	243.631,07	0,07
GENERAL MOTORS FIN 4 15-25 15/01S	USD	200.000	177.683,78	0,05
GOLDMAN SACHS GROUP 2.00 18-28 01/11A	EUR	300.000	271.525,50	0,08
GOLDMAN SACHS GROUP 2.60 20-30 07/02	USD	250.000	195.859,30	0,06
GOLDMAN SACHS GROUP 3.375 20-25 27/03A	EUR	150.000	148.023,00	0,04
GOLDMAN SACHS GROUP 4.25 14-26 29/01S	GBP	300.000	330.022,72	0,09
GOODYEAR TIRE RUBBER 5.00 16-26 31/05S	USD	165.000	147.864,05	0,04
HILTON GRAND VAC BOR 5.0 21-29 01/06S	USD	100.000	81.805,69	0,02
HUMANA 3.7 22-29 23/03S	USD	200.000	167.970,67	0,05
IBERDROLA INTL BV 6.75 06-36 15/07S	USD	200.000	207.357,47	0,06
IBM CORP 0.65 20-32 11/02A	EUR	100.000	77.186,50	0,02
IBM CORP 3.6250 23-31 06/02A	EUR	120.000	118.897,20	0,03
IQVIA INC 2.875 20-28 24/06S	EUR	100.000	90.366,50	0,03
JOHNSON & JOHNSON 1.15 16-28 20/11A	EUR	300.000	267.859,50	0,08
JPMORGAN CHASE CO 1.5 16-26 29/10A	EUR	389.000	360.149,81	0,10
JPMORGAN CHASE CO 2.875 13-28 24/05A/05A	EUR	289.000	273.937,32	0,08
JPMORGAN CHASE CO 2.95 16-26 01/10S1/10S	USD	318.000	273.455,22	0,08
JPMORGAN CHASE CO 3.125 15-25 23/01S	USD	394.000	349.186,56	0,10
KRAFT HEINZ FOODS CO 2.25 16-28 25/05A	EUR	403.000	373.026,87	0,11
KRAFT HEINZ FOODS CO 3.875 20-27 15/05SS	USD	100.000	87.915,21	0,02
LAMB WESTON HLD 4.8750 20-28 15/05S	USD	100.000	87.809,35	0,02
LEVI STRAUSS & CO 3.375 17-27 15/03S	EUR	400.000	379.786,00	0,11
LEVI STRAUSS & CO 3.50 21-31 01/03S	USD	100.000	76.228,69	0,02
LOWE'S COS INC 4.5000 20-30 15/04S	USD	250.000	222.433,55	0,06
MARRIOTT INTL 4.625 20-30 15/06S	USD	250.000	219.309,12	0,06
MASTERCARD INC 3.8500 20-50 26/03S	USD	200.000	158.052,25	0,04
MATTEL INC 3.375 21-26 19/03S	USD	100.000	84.561,87	0,02
MATTEL INC 3.75 21-29 01/04S	USD	200.000	161.106,33	0,05
MCDONALD'S CORP 2.125 20-30 05/03S	USD	250.000	195.080,20	0,06
MCDONALD'S CORP 4.00 23-30 07/03A	EUR	400.000	407.900,00	0,12
MCGRAW-HILL EDU 5.7500 21-28 01/08S	USD	100.000	79.510,54	0,02
MERCK & CO INC 1.9000 21-28 10/12S	USD	300.000	240.019,25	0,07
MERCK & CO INC 2.9 19-24 07/03S	USD	154.000	138.784,21	0,04
MICROSOFT CORP 3.30 17-27 06/02S	USD	200.000	176.319,89	0,05
MORGAN STANLEY 3.125 16-26 27/07S	USD	317.000	272.094,09	0,08
MORGAN STANLEY 3.95 15-27 23/04S	USD	200.000	173.447,30	0,05
MSCI INC 3.6250 20-30 01/09S	USD	100.000	79.417,51	0,02

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
NETFLIX INC 3.625 17-27 05/02S	EUR	200.000	195.713,00	0,06
NETFLIX INC 3.8750 19-29 15/11S	EUR	500.000	488.795,00	0,14
OMNICOM GROUP INC 2.45 20-30 30/04S	USD	200.000	153.794,69	0,04
OMNICOM GROUP INC 4.2 20-30 01/06S	USD	300.000	257.708,52	0,07
ORACLE CORP 2.65 16-26 15/07S	USD	350.000	296.885,66	0,08
ORGANON COMPANY 2.875 21-28 22/04S	EUR	200.000	174.211,00	0,05
PENSKE TRUCK LE 6.2000 23-30 15/06S	USD	200.000	184.250,23	0,05
PEPSICO INC 2.85 16-26 24/02S	USD	500.000	437.516,04	0,12
PEPSICO INC 3.60 22-28 18/02S	USD	150.000	132.340,97	0,04
PFIZER INC 3 16-26 15/12S	USD	200.000	173.128,32	0,05
PFIZER INC 7.20 09-39 15/03S	USD	300.000	342.350,59	0,10
PHILLIPS 66 2.15 20-30 10/06S	USD	200.000	149.519,70	0,04
PROLOGIS LP 2.1250 20-27 15/04S	USD	200.000	165.183,32	0,05
PRUDENTIAL FINANCIAL 2.10 20-30 10/03S	USD	150.000	116.008,71	0,03
RABOBANK NEW YORK 3.375 15-25 21/05S	USD	250.000	220.802,02	0,06
RALPH LAUREN CORP 2.95 20-30 03/06S	USD	250.000	202.116,18	0,06
RAYTHEON TECHNOLOGIE 2.25 20-30 18/05S	USD	150.000	115.939,27	0,03
SKYMILES IP LIMITED 4.75 20-28 20/10Q	USD	200.000	177.798,35	0,05
SOUTHWEST AIRLINES 5.125 20-27 15/06S	USD	300.000	273.021,99	0,08
SPRINT CORPORATION 7.625 18-26 01/03S	USD	500.000	476.109,08	0,13
STARBUCKS CORP 2.25 20-30 12/03S	USD	250.000	193.866,86	0,05
THE WALT DISNEY COMP 2.00 19-29 01/09S	USD	300.000	233.813,02	0,07
T-MOBILE USA INC 2.25 21-26 14/01S	USD	300.000	253.097,16	0,07
T-MOBILE USA INC 3.375 21-29 15/04S	USD	200.000	164.983,50	0,05
T-MOBILE USA INC 3.875 21-30 15/04S	USD	500.000	422.092,12	0,12
T-MOBILE USA INC 4.75 18-28 01/02S	USD	500.000	445.646,20	0,13
UNION PACIFIC CORP 3.95 18-28 10/09S	USD	300.000	266.378,55	0,08
UNITED RENTALS NA 5.5 16-27 15/05S15/05S	USD	154.000	139.204,14	0,04
STATI UNITI 5.00 07-37 15/05S	USD	1.650.000	1.710.164,12	0,48
STATI UNITI 6.75 96-26 15/08S	USD	2.600.000	2.536.269,75	0,72
STATI UNITI 7.625 95-25 15/02S	USD	1.400.000	1.333.227,12	0,38
VERIZON COMM 2.625 16-26 15/08S	USD	200.000	170.329,97	0,05
VERIZON COMM 3.15 20-30 20/03S	USD	200.000	163.058,66	0,05
VERIZON COMM 3.875 19-29 08/02S	USD	500.000	430.456,01	0,12
VERIZON COMM 4.329 18-28 21/09S	USD	300.000	264.672,32	0,07
VERIZON COMM 4.75 22-34 31/10A	EUR	350.000	367.419,50	0,10
VF CORP 2.95 20-30 23/04S	USD	100.000	75.437,21	0,02
VISTRA OPERATIONS CO 4.375 21-29 01/05S	USD	176.000	141.544,49	0,04
VISTRA OPERATIONS CO 5.125 22-25 13/05S	USD	100.000	89.393,68	0,03
VOLKSWAGEN GROUP 4.75 18-28 13/11S	USD	400.000	356.700,27	0,10
WELLS FARGO & CO 1.375 16-26 26/10A	EUR	225.000	204.084,00	0,06
WELLS FARGO & CO 2.00 16-25 28/07A	GBP	300.000	317.295,93	0,09
ZF NA CAPITAL 4.75 15-25 29/04S	USD	150.000	134.513,98	0,04
<b>Uruguay</b>			<b>1.823.941,34</b>	<b>0,51</b>
URUGUAY 4.375 15-27 27/10S	USD	2.000.000	1.823.941,34	0,51
<b>Notes a tasso variabile</b>			<b>17.061.764,82</b>	<b>4,81</b>
<b>Austria</b>			<b>358.558,00</b>	<b>0,10</b>
ERSTE GROUP BANK AG FL.R 20-XX 15/04S	EUR	200.000	152.865,00	0,04
OMV AG FL.R 15-XX 09/12A	EUR	200.000	205.693,00	0,06
<b>Belgio</b>			<b>190.022,00</b>	<b>0,05</b>
KBC GROUPE SA FL.R 17-29 18/09A	EUR	200.000	190.022,00	0,05
<b>Danimarca</b>			<b>174.190,65</b>	<b>0,05</b>
DANSKE BANK A/S FL.R 19-25 20/12S	USD	200.000	174.190,65	0,05

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Finlandia</b>			<b>187.552,10</b>	<b>0,05</b>
NORDEA BANK ABP FL.R 17-XX 12/03A	EUR	201.000	187.552,10	0,05
<b>Francia</b>			<b>3.702.349,36</b>	<b>1,04</b>
BNP PARIBAS FL.R 19-99 31/12S	USD	200.000	176.667,27	0,05
BNP PARIBAS SA FL.R 20-32 15/01A	EUR	300.000	255.660,00	0,07
BNP PARIBAS SA FL.R 20-XX 25/02S	USD	300.000	193.813,47	0,05
BNP PARIBAS SA FL.R 21-33 31/08A3 31/08A	EUR	300.000	237.526,50	0,07
CA ASSURANCES SA FL.R 18-48 29/01AA	EUR	300.000	263.896,50	0,07
CNP ASSURANCES FL.R 21-XX 07/10S	USD	200.000	136.869,85	0,04
CREDIT AGRICOLE SA FL.R 19-XX 23/03S	USD	200.000	176.373,97	0,05
CREDIT AGRICOLE SA FL.R 20-30 05/06A	EUR	200.000	185.362,00	0,05
CREDIT AGRICOLE SA FL.R 23-29 11/07A	EUR	200.000	198.770,00	0,06
CREDIT MUTUEL ARKEA FL.R 17-29 25/10A	EUR	300.000	285.238,50	0,08
EDF SA FL.R 14-XX 22/01A	EUR	200.000	189.142,00	0,05
EDF SA FL.R 20-XX 15/09A	EUR	200.000	154.222,00	0,04
EDF SA FL.R 23-XX 15/12S	USD	200.000	187.903,76	0,05
ENGIE SA FL.R 19-XX 28/02A	EUR	200.000	194.290,00	0,05
LA BANQUE POSTA FL.R 22-28 21/09A	GBP	100.000	108.677,39	0,03
SOCIETE GENERALE SA FL.R 21-29 12/06A	EUR	200.000	162.640,00	0,05
SOCIETE GENERALE SA FL.R 22-26 21/01Q	USD	200.000	181.168,65	0,05
VEOLIA ENVIRONNEMENT FL.R 20-XX 20/04A	EUR	500.000	414.127,50	0,12
<b>Germania</b>			<b>1.822.037,48</b>	<b>0,51</b>
ALLIANZ SE FL.R 20-XX 30/04A	USD	200.000	152.203,48	0,04
BAYER AG FL.R 22-82 25/03A	EUR	300.000	278.500,50	0,08
COMMERZBANK AG FL.R 20-30 05/12A	EUR	200.000	187.673,00	0,05
COMMERZBANK AG FL.R 21-31 29/12A	EUR	200.000	165.201,00	0,05
COMMERZBANK AG FL.R 22-27 14/09A	EUR	300.000	281.845,50	0,08
DEUTSCHE BANK AG FL.R 22-32 24/06A	EUR	300.000	264.478,50	0,07
DEUTSCHE BANK AG FL.R 22-XX 30/04A	EUR	200.000	198.813,00	0,06
DEUTSCHE BANK AG FL.R 23-29 11/01A	EUR	100.000	99.522,50	0,03
RWE AG REGS SUB FL.R 15-75 21/04A	EUR	200.000	193.800,00	0,05
<b>Hong Kong</b>			<b>457.756,65</b>	<b>0,13</b>
BANK OF CHINA HK FL.R 18-XX 14/03S	USD	500.000	457.756,65	0,13
<b>Irlanda</b>			<b>268.377,50</b>	<b>0,08</b>
AIB GROUP PLC FL.R 19-29 19/11A	EUR	200.000	188.215,00	0,05
ZURICH FIN IRELAND FL.R 20-50 17/09A	EUR	100.000	80.162,50	0,02
<b>Italia</b>			<b>1.421.323,37</b>	<b>0,40</b>
ASSICURAZ GENERALI FL.R 14-XX 21/11A	EUR	100.000	97.383,00	0,03
BANCA POPOLARE DELL FL.R 22-25 30/06A	EUR	200.000	197.237,00	0,06
ENI SPA FL.R 20-XX 13/01A	EUR	226.000	208.765,24	0,06
FINE BA FL.R 23-29 23/02A	EUR	200.000	198.946,00	0,06
UNICREDIT FL.R 22-27 15/11A	EUR	150.000	153.758,25	0,04
UNICREDIT SPA FL.R 20-32 15/01A	EUR	468.000	409.705,92	0,12
UNICREDIT SPA FL.R 20-35 30/06S	USD	200.000	155.527,96	0,04
<b>Paesi Bassi</b>			<b>2.429.497,61</b>	<b>0,69</b>
ABN AMRO BANK NV FL.R 22-33 22/02A	EUR	200.000	195.986,00	0,06
COOPERATIEVE RABOB FL.R 23-29 25/04A	EUR	200.000	197.884,00	0,06
DEUT TELEKOM INT FIN FL.R 00-30 15/06S	USD	500.000	546.791,93	0,15
IBERDROLA INTL BV FL.R 19-XX 12/02A	EUR	400.000	389.200,00	0,11
IBERDROLA INTL BV FL.R 20-XX 28/04A	EUR	200.000	164.719,00	0,05
ING GROUP NV FL.R 20-31 26/05A	EUR	200.000	181.768,00	0,05
RABOBANK FL.R 20-XX 29/06S	EUR	200.000	175.075,00	0,05
TELEFONICA EUROPE BV FL.R 18-XX 22/09A	EUR	200.000	185.279,00	0,05
TENNET HOLDING BV FL.R 20-XX 22/10A	EUR	109.000	102.619,68	0,03

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
VOLKSWAGEN INTL FIN FL.R 18-XX 27/06A	EUR	300.000	290.175,00	0,08
<b>Portogallo</b>			<b>154.598,00</b>	<b>0,04</b>
EDP SA FL.R 21-82 14/03AL.R 21-82 14/03A	EUR	200.000	154.598,00	0,04
<b>Spagna</b>			<b>1.469.437,04</b>	<b>0,41</b>
BANCO DE SABADELL SA FL.R 22-26 24/03A	EUR	300.000	285.465,00	0,08
BANCO SANTANDER FL.R 22-28 24/03S	USD	200.000	171.257,57	0,05
BANCO SANTANDER SA FL.R 17-XX 29/03Q	EUR	400.000	384.652,00	0,11
BANCO SANTANDER SA FL.R 18-XX 19/03Q	EUR	200.000	172.482,00	0,05
BANCO SANTANDER SA FL.R 19-24 02/08Q	USD	200.000	175.379,47	0,05
CAIXABANK SA FL.R 20-49 31/12Q	EUR	200.000	179.487,00	0,05
CAIXABANK SA FL.R 22-33 23/02A-23 23/02A	EUR	100.000	100.714,00	0,03
<b>Svezia</b>			<b>306.543,50</b>	<b>0,09</b>
SWEDBANK AB FL.R 18-28 18/09A	EUR	310.000	306.543,50	0,09
<b>Regno Unito</b>			<b>1.614.252,86</b>	<b>0,46</b>
BARCLAYS PLC FL.R 22-33 02/11S	USD	200.000	198.335,47	0,06
BP CAPITAL MARKETS FL.R 20-XX 22/06S	USD	400.000	333.893,67	0,09
HSBC HOLDINGS PLC FL.R 17-26 13/11A	GBP	102.000	106.077,51	0,03
HSBC HOLDINGS PLC FL.R 23-99 31/12S	USD	200.000	182.394,13	0,05
NATWEST GROUP FL.R 23-29 16/02A	EUR	100.000	98.651,00	0,03
NATWEST GROUP PLC FL.R 23-34 28/02A	EUR	120.000	118.747,80	0,03
VODAFONE GROUP PLC FL.R 21-81 04/06S	USD	100.000	72.705,78	0,02
VODAFONE GROUP PLC FL.R 23-84 30/08A	EUR	500.000	503.447,50	0,14
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>2.505.268,70</b>	<b>0,71</b>
AT&T INC FL.R 20-XX 01/05A	EUR	200.000	184.554,00	0,05
BANK OF AMERICA CORP FL.R 19-30 07/02S	USD	584.000	495.329,43	0,14
CITIGROUP INC FL.R 20-26 08/04S	USD	200.000	175.076,08	0,05
CITIGROUP INC FL.R 20-XX 30/01S	USD	275.000	217.823,44	0,06
GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 21-26 19/03Q	EUR	100.000	100.230,50	0,03
JPMORGAN CHASE & CO FL.R 21-27 22/04Q	USD	150.000	136.889,09	0,04
JPMORGAN CHASE & CO FL.R 21-27 22/09Q	USD	100.000	90.799,73	0,03
JPMORGAN CHASE CO FL.R 20-31 24/03S4/03S	USD	400.000	351.871,67	0,10
JPMORGAN CHASE CO FL.R 22-30 23/03A	EUR	200.000	176.840,00	0,05
MORGAN STANLEY CAPITAL FL.R 22-34 25/01A	EUR	200.000	209.979,00	0,06
MORGAN STANLEY FL.R 23-29 02/03A	EUR	120.000	120.673,20	0,03
WELLS FARGO AND CO FL.R 20-28 02/06S	USD	300.000	245.202,56	0,07
<b>Organismi di investimento collettivo</b>			<b>4.842.410,53</b>	<b>1,37</b>
<b>Azioni/quote di fondi di investimento</b>			<b>4.842.410,53</b>	<b>1,37</b>
<b>Irlanda</b>			<b>3.453.390,69</b>	<b>0,97</b>
ISHARES CORE EUR CORP BD EUR ETF	EUR	732.815	3.453.390,69	0,97
<b>Lussemburgo</b>			<b>1.389.019,84</b>	<b>0,39</b>
AMUNDI FUNDS SICAV - EMERGING MARKETS CO	EUR	1.760	1.389.019,84	0,39
<b>Totale portafoglio titoli</b>			<b>318.333.585,22</b>	<b>89,76</b>
<b>Depositi bancari/(saldi passivi)</b>			<b>42.624.907,10</b>	<b>12,02</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>			<b>-6.298.372,96</b>	<b>-1,78</b>
<b>Totale attività nette</b>			<b>354.660.119,36</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il  
28 settembre 2022)**

---

**Ripartizione geografica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)**

<b>Paese</b>	<b>% delle attività nette</b>
Germania	16,01
Stati Uniti d'America	15,00
Francia	9,73
Regno Unito	7,46
Italia	6,62
Irlanda	5,82
Paesi Bassi	4,94
Spagna	3,81
Messico	2,32
Indonesia	2,02
Svizzera	1,79
Ungheria	1,33
Filippine	0,93
Romania	0,89
Panama	0,79
Sudafrica	0,70
Svezia	0,65
Danimarca	0,65
Belgio	0,60
Lussemburgo	0,57
Uruguay	0,51
Hong Kong	0,50
Arabia Saudita	0,47
Guatemala	0,38
Polonia	0,36
Turchia	0,36
Isole Cayman	0,36
Emirati Arabi Uniti	0,34
Canada	0,34
Costa d'Avorio	0,33
Cile	0,32
Qatar	0,30
Croazia	0,28
Finlandia	0,25
Nigeria	0,22
Colombia	0,21
Brasile	0,18
Repubblica Dominicana	0,18
Portogallo	0,17
Norvegia	0,15
Austria	0,15
Oman	0,13
Marocco	0,11
Repubblica Ceca	0,11
Mauritius	0,10
Australia	0,10
Bulgaria	0,08
Curacao	0,06
Egitto	0,05
Giappone	0,02
Cina	0,01
Israele	-
<b>Totale</b>	<b>89,76</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>10,24</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il  
28 settembre 2022)**

---

**Ripartizione economica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)**

<b>Settore</b>	<b>% delle attività nette</b>
Obbligazioni di Stati, province e comuni	35,50
Holding e società finanziarie	11,63
Banche e altre istituzioni finanziarie	10,52
Servizi di pubblica utilità	3,44
Comunicazioni	3,20
Prodotti farmaceutici e cosmetici	3,11
Internet e servizi Internet	2,17
Petrolio	1,89
Trasporto	1,70
Cibi e bevande non alcoliche	1,69
Fondi di investimento	1,37
Prodotti chimici	1,30
Veicoli stradali	0,94
Forniture per ufficio e informatica	0,86
Industria aeronautica e aerospaziale	0,85
Ingegneria elettrica ed elettronica	0,81
Assicurazione	0,77
Elettronica e semiconduttori	0,76
Alberghi e ristoranti	0,76
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	0,73
Società immobiliari	0,70
Servizi vari	0,64
Tabacco e bevande alcoliche	0,62
Beni di consumo vari	0,62
Costruzione di macchine e apparecchi	0,43
Arti grafiche ed editoria	0,40
Imballaggi	0,36
Servizi sanitari e sociali	0,35
Tessile e abbigliamento	0,34
Materiali per l'edilizia e commercio	0,33
Metalli e pietre preziose	0,32
Pneumatici e gomma	0,19
Miniere di carbone e industria siderurgica	0,15
Biotecnologie	0,10
Agricoltura e pesca	0,09
Beni strumentali vari	0,05
Carta e prodotti forestali	0,04
Metalli non ferrosi	0,02
Servizi ambientali e riciclo	0,01
<b>Totale</b>	<b>89,76</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>10,24</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate  
Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)**



# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	Nota	Importi in euro
<b>Attività</b>		<b>385.682.277,74</b>
Portafoglio titoli a valore di mercato	2b	377.873.299,13
<i>Prezzo di costo</i>	2f	357.217.702,07
Depositi bancari		4.021.507,60
Sottoscrizioni da incassare		3.357.553,21
Dividendi da incassare, netti	2c	396.409,89
Oneri di costituzione, netti	2i	33.507,91
<b>Passività</b>		<b>7.998.846,44</b>
Debiti su investimenti acquistati		6.115.123,58
Debiti per riscatti		541.843,25
Commissioni di gestione dovute	3	1.002.657,13
Commissioni dovute a Depositario, Amministrazione Centrale e Agenti per il pagamento	4.5	219.012,28
Imposta di sottoscrizione dovuta ("Taxe d'abonnement")	9	35.729,08
Debiti su cambi		1.814,69
Altre passività		82.666,23
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>377.683.431,50</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

### Conto economico e variazioni delle attività nette dal 28/09/22 al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Proventi</b>		<b>3.820.627,46</b>
Dividendi netti	2c	3.783.439,86
Interessi bancari sui conti correnti		36.973,32
Altri proventi		214,28
<b>Oneri</b>		<b>2.520.487,27</b>
Commissioni di gestione e di consulenza	3	1.673.891,38
Commissioni del Depositario, dell'Amministrazione Centrale e degli Agenti per il pagamento	4.5	366.307,72
Ammortamento degli oneri di costituzione	2i	10.768,51
Commissioni di transazione	6	302.226,56
Imposta di sottoscrizione ("Taxe d'abonnement")	9	64.615,61
Interessi bancari sugli scoperti		523,49
Altri oneri		102.154,00
<b>Utile / (perdita) netto(a) da investimenti</b>		<b>1.300.140,19</b>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
- vendite di portafoglio titoli	2d	853.030,01
- cambi	2h	-1.383.748,79
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a)</b>		<b>769.421,41</b>
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
- portafoglio titoli	2b	20.655.597,06
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette a seguito delle operazioni</b>		<b>21.425.018,47</b>
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		356.258.413,03
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>377.683.431,50</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>377.683.431,50</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>377.683.431,50</b>
<b>A - EUR</b>		
Numero di azioni		1.739.021,654
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	113,38
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		358.161,020
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	113,10
<b>M - EUR</b>		
Numero di azioni		109.813,021
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	113,40
<b>MD - EUR</b>		
Numero di azioni		99.511,947
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	113,39
<b>O - EUR</b>		
Numero di azioni		2.051,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	113,73
<b>OD - EUR</b>		
Numero di azioni		7.985,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	113,93
<b>U - EUR</b>		
Numero di azioni		2.489,205
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	114,11
<b>UD - EUR</b>		
Numero di azioni		99,900
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	107,25
<b>E - EUR</b>		
Numero di azioni		986.947,776
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	116,35

# onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Valori mobiliari ammessi alla quotazione ufficiale in una borsa valori e/o negoziati su un altro mercato regolamentato</b>			<b>377.873.299,13</b>	<b>100,05</b>
<b>Azioni</b>			<b>377.873.299,13</b>	<b>100,05</b>
<b>Canada</b>			<b>5.747.282,68</b>	<b>1,52</b>
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	CAD	146.700	5.747.282,68	1,52
<b>Danimarca</b>			<b>7.428.160,89</b>	<b>1,97</b>
NOVO NORDISK	DKK	50.309	7.428.160,89	1,97
<b>Francia</b>			<b>37.411.209,67</b>	<b>9,91</b>
BNP PARIBAS SA	EUR	95.295	5.500.427,40	1,46
CAPGEMINI SE	EUR	36.794	6.385.598,70	1,69
CIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	69.511	3.873.848,03	1,03
PUBLICIS GROUPE	EUR	88.802	6.526.947,00	1,73
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	53.155	8.848.181,30	2,34
VINCI SA	EUR	58.998	6.276.207,24	1,66
<b>Germania</b>			<b>18.145.512,56</b>	<b>4,80</b>
ALLIANZ SE PREFERENTIAL SHARE	EUR	26.668	5.685.617,60	1,51
BMW AG	EUR	47.878	5.387.232,56	1,43
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	EUR	20.584	7.072.662,40	1,87
<b>Irlanda</b>			<b>20.960.036,79</b>	<b>5,55</b>
KINGSPAN GROUP	EUR	76.471	4.657.083,90	1,23
MEDTRONIC HLD	USD	89.685	7.242.207,61	1,92
TRANE TECH - REGISTERED SHS	USD	51.685	9.060.745,28	2,40
<b>Giappone</b>			<b>21.263.069,98</b>	<b>5,63</b>
SEKISUI HOUSE LTD	JPY	213.800	3.939.406,18	1,04
SONY CORP	JPY	107.000	8.797.483,89	2,33
TAKEDA PHARMACEUTICAL	JPY	202.600	5.816.371,22	1,54
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	JPY	128.900	2.709.808,69	0,72
<b>Paesi Bassi</b>			<b>3.990.307,74</b>	<b>1,06</b>
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	127.649	3.990.307,74	1,06
<b>Svezia</b>			<b>10.960.408,17</b>	<b>2,90</b>
TELE2 AB	SEK	541.675	4.096.491,16	1,08
VOLVO AB -B-	SEK	362.718	6.863.917,01	1,82
<b>Svizzera</b>			<b>8.608.967,27</b>	<b>2,28</b>
GIVAUDAN SA REG.SHS	CHF	1.512	4.593.084,37	1,22
ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	CHF	9.225	4.015.882,90	1,06
<b>Regno Unito</b>			<b>28.571.667,89</b>	<b>7,56</b>
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	USD	156.862	9.263.628,47	2,45
LLOYDS BANKING GROUP PLC	GBP	13.859.068	7.039.757,32	1,86
NATIONAL GRID PLC	GBP	318.455	3.861.241,37	1,02
NEXT PLC	GBP	104.558	8.407.040,73	2,23
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>214.786.675,49</b>	<b>56,87</b>
ABBVIE INC	USD	66.442	8.205.069,35	2,17
ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	71.834	7.500.101,69	1,99
APPLIED MATERIALS INC	USD	14.594	1.933.470,91	0,51
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	USD	11.260	2.268.410,08	0,60
BALL CORP	USD	64.980	3.466.989,73	0,92
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	122.443	7.177.112,60	1,90
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	USD	12.693	10.091.923,91	2,67
CISCO SYSTEMS INC	USD	167.425	7.940.027,04	2,10
DEERE AND CO	USD	22.621	8.401.285,97	2,22
DELL TECHNOLOGIES PREFERENTIAL SHARE	USD	128.666	6.381.409,04	1,69

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

**onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il  
28 settembre 2022)**

**Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23**

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
ECOLAB INC	USD	48.022	8.217.440,13	2,18
GRAPHIC PACKAGING	USD	140.229	3.088.636,91	0,82
HOME DEPOT INC	USD	33.486	9.534.455,58	2,52
IBM CORP	USD	32.139	3.941.814,47	1,04
JPMORGAN CHASE CO	USD	84.575	11.274.599,45	2,99
MASTERCARD INC -A-	USD	29.132	10.501.939,14	2,78
MERCK & CO INC	USD	105.568	11.165.436,77	2,96
MICROSOFT CORP	USD	91.059	28.422.760,64	7,53
NVIDIA CORP	USD	34.016	13.189.228,52	3,49
PROLOGIS	USD	64.914	7.296.428,80	1,93
QUALCOMM INC	USD	71.032	7.750.365,98	2,05
TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	47.678	7.867.088,51	2,08
TRACTOR SUPPLY CO	USD	36.763	7.450.320,16	1,97
WALT DISNEY CO	USD	63.824	5.222.920,92	1,38
WW GRAINGER INC	USD	11.274	8.149.004,27	2,16
XYLEM INC	USD	80.875	8.348.434,92	2,21
<b>Totale portafoglio titoli</b>			<b>377.873.299,13</b>	<b>100,05</b>
<b>Depositi bancari/(saldi passivi)</b>			<b>4.021.507,60</b>	<b>1,06</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>			<b>-4.211.375,23</b>	<b>-1,12</b>
<b>Totale attività nette</b>			<b>377.683.431,50</b>	<b>100,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

---

### Ripartizione geografica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Paese</b>	<b>% delle attività nette</b>
Stati Uniti d'America	56,87
Francia	9,91
Regno Unito	7,56
Giappone	5,63
Irlanda	5,55
Germania	4,80
Svezia	2,90
Svizzera	2,28
Danimarca	1,97
Canada	1,52
Paesi Bassi	1,06
<b>Totale</b>	<b>100,05</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>-0,05</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

### Ripartizione economica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Settore</b>	<b>% delle attività nette</b>
Prodotti farmaceutici e cosmetici	12,45
Banche e altre istituzioni finanziarie	10,61
Elettronica e semiconduttori	10,40
Internet e servizi Internet	9,82
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	7,78
Forniture per ufficio e informatica	5,82
Materiali per l'edilizia e commercio	4,96
Costruzione di macchine e apparecchi	4,62
Ingegneria elettrica ed elettronica	4,50
Assicurazione	4,44
Prodotti chimici	3,39
Veicoli stradali	3,25
Servizi di pubblica utilità	3,23
Holding e società finanziarie	3,23
Comunicazioni	3,14
Arti grafiche ed editoria	3,11
Cibi e bevande non alcoliche	2,45
Società immobiliari	1,93
Imballaggi	0,92
<b>Totale</b>	<b>100,05</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>-0,05</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World  
Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre  
2022)**

## onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)

### Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>812.520.547,07</b>
Portafoglio titoli a valore di mercato	2b	773.757.212,12
<i>Prezzo di costo</i>	2f	743.664.265,18
Depositi bancari		31.224.145,62
Sottoscrizioni da incassare		6.921.451,06
Dividendi da incassare, netti	2c	584.191,20
Oneri di costituzione, netti	2i	33.547,07
<b>Passività</b>		<b>22.206.765,16</b>
Debiti su investimenti acquistati		19.088.581,81
Debiti per riscatti		466.407,17
Commissioni di gestione dovute	3	2.008.489,15
Commissioni dovute a Depositario, Amministrazione Centrale e Agenti per il pagamento	4.5	440.210,80
Imposta di sottoscrizione dovuta ("Taxe d'abonnement")	9	80.230,35
Debiti su cambi		1.715,77
Altre passività		121.130,11
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>790.313.781,91</b>



## onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)

### Conto economico e variazioni delle attività nette dal 29/09/22 al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Proventi</b>		<b>7.526.319,36</b>
Dividendi netti	2c	7.086.313,21
Interessi bancari sui conti correnti		428.916,78
Altri proventi		11.089,37
<b>Oneri</b>		<b>4.966.193,66</b>
Commissioni di gestione e di consulenza	3	3.264.180,88
Commissioni del Depositario, dell'Amministrazione Centrale e degli Agenti per il pagamento	4,5	723.225,59
Ammortamento degli oneri di costituzione	2i	10.729,35
Commissioni di transazione	6	689.436,03
Imposta di sottoscrizione ("Taxe d'abonnement")	9	138.115,25
Interessi bancari sugli scoperti		34,87
Altri oneri	2g	140.471,69
<b>Utile / (perdita) netto(a) da investimenti</b>		<b>2.560.125,70</b>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
- vendite di portafoglio titoli	2d	650.813,83
- contratti di cambio a termine	2b	8.640,18
- cambi	2h	-425.070,74
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a)</b>		<b>2.794.508,97</b>
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
- portafoglio titoli	2b	30.092.946,94
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette a seguito delle operazioni</b>		<b>32.887.455,91</b>
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		757.426.326,00
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>790.313.781,91</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>790.313.781,91</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>790.313.781,91</b>
<b>A - EUR</b>		
Numero di azioni		2.444.333,061
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	110,20
<b>AD - EUR</b>		
Numero di azioni		1.324.645,897
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	110,21
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		515.844,170
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	109,91
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		283.528,311
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	109,90
<b>M - EUR</b>		
Numero di azioni		194.355,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	110,17
<b>MD - EUR</b>		
Numero di azioni		630.921,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	110,17
<b>O - EUR</b>		
Numero di azioni		9.584,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	110,37
<b>OD - EUR</b>		
Numero di azioni		79.376,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	110,35
<b>U - EUR</b>		
Numero di azioni		3.889,372
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	111,17
<b>UD - EUR</b>		
Numero di azioni		2.638,115
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	112,89
<b>D - EUR</b>		
Numero di azioni		160.429,470
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	109,10
<b>E - EUR</b>		
Numero di azioni		1.490.259,424
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	112,82

# onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Valori mobiliari ammessi alla quotazione ufficiale in una borsa valori e/o negoziati su un altro mercato regolamentato</b>			<b>773.757.212,12</b>	<b>97,91</b>
<b>Azioni</b>			<b>773.757.212,12</b>	<b>97,91</b>
<b>Bermuda</b>				
HISCOX	GBP	967.287	12.297.501,80	1,56
<b>Francia</b>				
AIR LIQUIDE SA	EUR	97.162	15.954.000,40	2,02
LEGRAND SA	EUR	177.311	16.099.838,80	2,04
SANOFI	EUR	286.494	28.133.710,80	3,56
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	134.126	22.326.613,96	2,83
<b>Germania</b>				
DEUTSCHE BOERSE AG REG SHS	EUR	227.288	38.434.400,80	4,86
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	EUR	82.230	28.254.228,00	3,58
SAP AG	EUR	56.236	7.037.373,04	0,89
<b>Guernsey</b>				
AMDOCS LTD	USD	341.251	30.919.029,65	3,91
<b>India</b>				
HOUSING DEVT FINANCE ADR REPR 3 SHS	USD	44.796	2.861.852,61	0,36
<b>Irlanda</b>				
LINDE PLC	USD	71.141	24.849.140,49	3,14
<b>Giappone</b>				
ASTELLAS PHARMA	JPY	969.400	13.211.180,07	1,67
BRIDGESTONE CORP	JPY	462.600	17.285.046,33	2,19
NIPPON TELEGRAPH AND TELEPHONE CORP	JPY	17.129.100	18.520.858,32	2,34
<b>Paesi Bassi</b>				
FERROVIAL INTERNATIONAL SE	EUR	475.881	13.786.272,57	1,74
WOLTERS KLUWER NV	EUR	289.096	33.621.864,80	4,25
<b>Spagna</b>				
IBERDROLA SA	EUR	2.571.611	30.730.751,45	3,89
<b>Svezia</b>				
SANDVIK AB	SEK	588.923	10.504.836,08	1,33
<b>Svizzera</b>				
ROCHE HOLDING LTD	CHF	95.672	26.808.352,03	3,39
ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	CHF	44.970	19.576.612,88	2,48
<b>Taiwan</b>				
TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS)	USD	243.691	22.541.975,91	2,85
<b>Regno Unito</b>				
ADMIRAL GROUP PLC	GBP	911.655	22.118.111,17	2,80
INFORMA PLC	GBP	2.269.809	19.202.719,04	2,43
RELX PLC	EUR	1.200.916	36.675.974,64	4,64
UNILEVER	EUR	791.686	37.771.339,06	4,78
<b>Stati Uniti d'America</b>				
BLACKROCK INC	USD	16.192	10.257.505,85	1,30
CISCO SYSTEMS INC	USD	590.351	27.997.030,93	3,54
CME GROUP -A-	USD	145.066	24.637.286,10	3,12
FASTENAL CO	USD	215.684	11.661.960,73	1,48
LOWE'S CO INC	USD	53.391	11.045.232,54	1,40
MARSH MCLENNAN COS	USD	223.697	38.563.640,48	4,88
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	USD	32.476	3.749.177,09	0,47
PROCTER & GAMBLE CO	USD	109.473	15.225.878,11	1,93

# onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
PROGRESSIVE CORP	USD	337.624	40.963.601,17	5,18
TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	103.580	17.091.174,70	2,16
WW GRAINGER INC	USD	31.877	23.041.139,72	2,92
<b>Totale portafoglio titoli</b>			<b>773.757.212,12</b>	<b>97,91</b>
<b>Depositi bancari/(saldi passivi)</b>			<b>31.224.145,62</b>	<b>3,95</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>			<b>-14.667.575,83</b>	<b>-1,86</b>
<b>Totale attività nette</b>			<b>790.313.781,91</b>	<b>100,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)

---

### Ripartizione geografica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Paese</b>	<b>% delle attività nette</b>
Stati Uniti d'America	28,37
Regno Unito	14,65
Francia	10,44
Germania	9,33
Giappone	6,20
Paesi Bassi	6,00
Svizzera	5,87
Guernsey	3,91
Spagna	3,89
Irlanda	3,15
Taiwan	2,85
Bermuda	1,56
Svezia	1,33
India	0,36
<b>Totale</b>	<b>97,91</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>2,09</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

### Ripartizione economica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Settore</b>	<b>% delle attività nette</b>
Holding e società finanziarie	19,28
Assicurazione	18,91
Arti grafiche ed editoria	11,32
Ingegneria elettrica ed elettronica	7,78
Prodotti farmaceutici e cosmetici	5,06
Elettronica e semiconduttori	5,02
Internet e servizi Internet	4,80
Cibi e bevande non alcoliche	4,78
Servizi di pubblica utilità	3,89
Forniture per ufficio e informatica	3,54
Costruzione di macchine e apparecchi	2,81
Comunicazioni	2,34
Pneumatici e gomma	2,19
Prodotti chimici	2,02
Beni di consumo vari	1,93
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	1,40
Banche e altre istituzioni finanziarie	0,84
<b>Totale</b>	<b>97,91</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>2,09</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets BlackRock  
Global Equity Dynamic Opportunies Fund  
(lanciato il 30 settembre 2022)**

## onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

### Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>202.370.880,40</b>
Portafoglio titoli a valore di mercato	2b	189.083.668,07
<i>Prezzo di costo</i>	2f	176.887.599,89
Opzioni (posizioni lunghe) a valore di mercato	2b	1.322.618,68
<i>Opzioni acquistate al costo</i>	2f	1.082.293,84
Depositi bancari		8.169.020,98
Credito per garanzia	10	36.663,61
Credito a fronte cessione investimenti		580.413,47
Sottoscrizioni da incassare		3.015.376,71
Plusvalenza netta non realizzata su futures finanziari	2b	48.424,15
Dividendi da incassare, netti	2c	81.108,51
Oneri di costituzione, netti	2i	33.586,22
<b>Passività</b>		<b>6.981.229,14</b>
Opzioni (posizioni corte) a valore di mercato	2b	717.180,13
<i>Opzioni vendute al costo</i>	2f	557.831,41
Scoperti bancari		44.366,49
Garanzie da versare	10	27.497,71
Debiti su investimenti acquistati		4.870.513,95
Debiti per riscatti		434.117,02
Minusvalenza netta non realizzata su contratti forward sui cambi	2b	169.164,13
Commissioni di gestione dovute	3	520.116,98
Commissioni dovute a Depositario, Amministrazione Centrale e Agenti per il pagamento	4.5	103.830,76
Imposta di sottoscrizione dovuta ("Taxe d'abonnement")	9	22.038,81
Debiti su cambi		10.068,03
Altre passività		62.335,13
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>195.389.651,26</b>

## onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

### Conto economico e variazioni delle attività nette dal 30/09/22 al 30/06/23

	Nota	Importi in euro
<b>Proventi</b>		<b>1.179.263,25</b>
Dividendi netti	2c	1.107.087,66
Interessi bancari sui conti correnti		71.794,95
Altri proventi		380,64
<b>Oneri</b>		<b>1.344.746,95</b>
Commissioni di gestione e di consulenza	3	846.638,30
Commissioni del Depositario, dell'Amministrazione Centrale e degli Agenti per il pagamento	4.5	175.636,09
Ammortamento degli oneri di costituzione	2i	10.690,20
Commissioni di transazione	6	190.683,27
Imposta di sottoscrizione ("Taxe d'abonnement")	9	37.991,48
Interessi bancari sugli scoperti		1.352,43
Altri oneri	2g	81.755,18
<b>Utile / (perdita) netto(a) da investimenti</b>		<b>-165.483,70</b>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
- vendite di portafoglio titoli	2d	1.245.337,97
- opzioni	2b	509.432,25
- contratti di cambio a termine	2b	-381.966,85
- futures finanziari	2b	158.589,40
- cambi	2h	-584.880,70
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a)</b>		<b>781.028,37</b>
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
- portafoglio titoli	2b	12.196.068,18
- opzioni	2b	80.976,12
- contratti di cambio a termine	2b	-169.164,13
- futures finanziari	2b	48.424,15
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette a seguito delle operazioni</b>		<b>12.937.332,69</b>
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		182.452.318,57
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>195.389.651,26</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>195.389.651,26</b>



# onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>195.389.651,26</b>
<b>A - EUR</b>		
Numero di azioni		1.077.591,048
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	111,73
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		213.392,660
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	111,47
<b>M - EUR</b>		
Numero di azioni		105.155,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	111,70
<b>MD - EUR</b>		
Numero di azioni		120.652,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	111,73
<b>O - EUR</b>		
Numero di azioni		6.955,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	111,85
<b>OD - EUR</b>		
Numero di azioni		10.659,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	111,83
<b>U - EUR</b>		
Numero di azioni		1.327,764
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	112,17
<b>E - EUR</b>		
Numero di azioni		205.102,198
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	116,34

# onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Valori mobiliari ammessi alla quotazione ufficiale in una borsa valori e/o negoziati su un altro mercato regolamentato</b>			<b>188.656.479,04</b>	<b>96,55</b>
<b>Azioni</b>			<b>188.656.479,04</b>	<b>96,55</b>
<b>Bermuda</b>				
BUNGE LTD	USD	16.085	1.391.035,52	0,71
<b>Canada</b>				
ENBRIDGE INC	CAD	48.541	1.655.578,61	0,85
<b>Cina</b>				
BYD COMPANY LTD -H-	HKD	33.000	964.946,14	0,49
<b>Curacao</b>				
SLB	USD	15.147	681.962,09	0,35
<b>Finlandia</b>				
NESTE	EUR	38.876	1.370.767,76	0,70
<b>Francia</b>				
ACCOR SA	EUR	8.014	272.636,28	0,14
BNP PARIBAS SA	EUR	35.162	2.029.550,64	1,04
CIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	38.433	2.141.871,09	1,10
DANONE SA	EUR	15.730	883.082,20	0,45
ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	10.463	1.805.913,80	0,92
HERMES INTERNATIONAL SA	EUR	1.918	3.816.820,00	1,95
SANOFI	EUR	4.119	404.485,80	0,21
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	10.932	1.819.740,72	0,93
TOTALENERGIES SE	EUR	14.968	786.568,40	0,40
VINCI SA	EUR	7.044	749.340,72	0,38
<b>Germania</b>				
MERCEDES-BENZ GROUP	EUR	19.432	1.431.555,44	0,73
SAP AG	EUR	40.103	5.018.489,42	2,57
SIEMENS AG PREFERENTIAL SHARE	EUR	16.719	2.550.316,26	1,31
<b>Hong Kong</b>				
AIA GROUP LTD	HKD	243.800	2.255.585,58	1,15
<b>Irlanda</b>				
TRANE TECH - REGISTERED SHS	USD	6.947	1.217.858,13	0,62
<b>Israele</b>				
NICE SYSTEMS ADR REPR.SHS	USD	5.565	1.053.320,35	0,54
<b>Italia</b>				
INTESA SANPAOLO	EUR	271.764	652.233,60	0,33
<b>Giappone</b>				
FANUC CORP SHS	JPY	104.100	3.321.953,46	1,70
HONDA MOTOR CO LTD	JPY	42.600	1.172.739,54	0,60
HOYA CORP	JPY	8.300	898.754,31	0,46
JAPAN AIRLINES CO LTD	JPY	47.100	931.917,96	0,48
KEYENCE CORP	JPY	4.100	1.764.151,55	0,90
SYSMEX	JPY	15.700	975.925,20	0,50
TOYOTA MOTOR CORP	JPY	78.300	1.146.288,20	0,59
<b>Jersey</b>				
APTIV PLC	USD	20.409	1.909.766,10	0,98
<b>Paesi Bassi</b>				
ADYEN	EUR	518	821.444,40	0,42
AKZO NOBEL NV	EUR	13.044	974.647,68	0,50
ASML HOLDING NV	EUR	6.239	4.136.457,00	2,12

# onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
ING GROUP NV	EUR	271.088	3.344.683,74	1,71
<b>Corea del Sud</b>			<b>684.681,99</b>	<b>0,35</b>
SK HYNIX INC	KRW	8.544	684.681,99	0,35
<b>Spagna</b>			<b>1.802.855,61</b>	<b>0,92</b>
CELLNEX TELECOM SA	EUR	48.739	1.802.855,61	0,92
<b>Svizzera</b>			<b>7.008.135,03</b>	<b>3,59</b>
ALCON - REGISTERED SHS	CHF	22.245	1.688.801,29	0,86
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	CHF	35.664	3.931.608,42	2,01
TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	USD	10.802	1.387.725,32	0,71
<b>Taiwan</b>			<b>2.066.778,70</b>	<b>1,06</b>
TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS)	USD	22.343	2.066.778,70	1,06
<b>Regno Unito</b>			<b>11.757.639,99</b>	<b>6,02</b>
ASTRAZENECA PLC	GBP	29.704	3.903.074,10	2,00
BP PLC	GBP	45.156	241.184,56	0,12
COMPASS GROUP	GBP	44.936	1.153.051,01	0,59
LLOYDS BANKING GROUP PLC	GBP	1.683.078	854.924,78	0,44
RELX PLC	GBP	41.236	1.259.448,30	0,64
SHELL PLC	GBP	53.829	1.469.375,20	0,75
UNILEVER	GBP	60.245	2.876.582,04	1,47
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>108.984.000,03</b>	<b>55,78</b>
ABBOTT LABORATORIES	USD	32.959	3.293.483,21	1,69
ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	12.201	1.273.891,76	0,65
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	USD	7.196	1.975.635,09	1,01
ALBEMARLE - REGISTERED SHS	USD	3.965	810.771,63	0,41
ALPHABET INC -C-	USD	47.264	5.240.628,85	2,68
AMAZON.COM INC	USD	21.512	2.570.398,09	1,32
AMERICAN TOWER CORP	USD	16.282	2.894.345,63	1,48
APPLE INC	USD	27.625	4.911.476,86	2,51
APPLIED MATERIALS INC	USD	16.625	2.202.545,83	1,13
ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	USD	41.971	2.906.809,13	1,49
BANK OF AMERICA CORP	USD	8.607	226.338,07	0,12
BOSTON SCIENTIF CORP	USD	56.052	2.778.966,71	1,42
CARRIER GLOBAL CORP-WI	USD	32.961	1.501.825,22	0,77
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	USD	9.845	626.434,37	0,32
COSTCO WHOLESALE CORP	USD	5.027	2.480.693,18	1,27
DEERE AND CO	USD	4.907	1.822.426,52	0,93
DELTA AIR LINES	USD	39.298	1.712.398,64	0,88
DEXCOM INC	USD	11.360	1.338.105,96	0,68
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	20.756	1.794.604,47	0,92
ELI LILLY & CO	USD	12.946	5.565.000,07	2,85
FORTIVE CORPORATION	USD	33.072	2.266.538,44	1,16
FREEMPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	USD	11.213	411.109,07	0,21
HILTON WORLDWIDE HLDGS INC REG SHS	USD	15.815	2.109.874,66	1,08
HOME DEPOT INC	USD	2.441	695.024,97	0,36
HUMANA INC	USD	4.751	1.947.126,15	1,00
INTUIT	USD	1.807	758.890,31	0,39
INTUITIVE SURGICAL	USD	9.832	3.081.534,45	1,58
JPMORGAN CHASE CO	USD	3.927	523.504,01	0,27
LOWE'S CO INC	USD	3.599	744.541,06	0,38
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	USD	10.603	2.113.116,67	1,08
MARSH MCLENNAN COS	USD	25.005	4.310.669,48	2,21
MASTERCARD INC -A-	USD	11.299	4.073.232,54	2,08
MICRON TECHNOLOGY INC	USD	11.685	675.930,66	0,35
MICROSOFT CORP	USD	30.339	9.469.883,65	4,85
MORGAN STANLEY	USD	650	50.879,93	0,03

# onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
NVIDIA CORP	USD	10.453	4.053.004,64	2,07
PROGRESSIVE CORP	USD	5.936	720.209,28	0,37
ROCKWELL AUTOMATION	USD	3.857	1.164.700,87	0,60
SALESFORCE INC	USD	13.449	2.604.249,07	1,33
SEMPRA ENERGY	USD	17.890	2.387.355,73	1,22
SERVICENOW INC	USD	1.666	858.150,34	0,44
TESLA MOTORS INC	USD	13.162	3.158.035,51	1,62
THERMO FISHER SCIENT SHS	USD	6.140	2.936.338,22	1,50
TRACTOR SUPPLY CO	USD	5.573	1.129.413,66	0,58
UBER TECH PREFERENTIAL SHARE	USD	4.248	168.089,97	0,09
UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	6.867	3.025.256,54	1,55
UNITED PARCEL SERVICE INC	USD	8.460	1.389.967,92	0,71
VISA INC -A-	USD	6.039	1.314.520,37	0,67
VULCAN MATERIALS CO	USD	1.627	336.196,96	0,17
WALT DISNEY CO	USD	23.608	1.931.917,73	0,99
ZOETIS INC -A-	USD	4.105	647.957,88	0,33
<b>Organismi di investimento collettivo</b>			<b>427.189,03</b>	<b>0,22</b>
<b>Azioni/quote di fondi di investimento</b>			<b>427.189,03</b>	<b>0,22</b>
<b>Irlanda</b>			<b>427.189,03</b>	<b>0,22</b>
INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC BLACKRO	USD	4.391	427.189,03	0,22
<b>Totale portafoglio titoli</b>			<b>189.083.668,07</b>	<b>96,77</b>
<b>Depositi bancari/(saldi passivi)</b>			<b>8.124.654,49</b>	<b>4,16</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>			<b>-1.818.671,30</b>	<b>-0,93</b>
<b>Totale attività nette</b>			<b>195.389.651,26</b>	<b>100,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

---

### Ripartizione geografica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Paese</b>	<b>% delle attività nette</b>
Stati Uniti d'America	55,78
Francia	7,53
Regno Unito	6,02
Giappone	5,22
Paesi Bassi	4,75
Germania	4,61
Svizzera	3,59
Hong Kong	1,15
Taiwan	1,06
Jersey	0,98
Spagna	0,92
Canada	0,85
Irlanda	0,84
Bermuda	0,71
Finlandia	0,70
Israele	0,54
Cina	0,49
Curacao	0,35
Corea del Sud	0,35
Italia	0,33
<b>Totale</b>	<b>96,77</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>3,23</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

---

### Ripartizione economica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Settore</b>	<b>% delle attività nette</b>
Prodotti farmaceutici e cosmetici	12,89
Internet e servizi Internet	12,34
Elettronica e semiconduttori	12,24
Banche e altre istituzioni finanziarie	6,41
Cibi e bevande non alcoliche	6,14
Ingegneria elettrica ed elettronica	5,30
Veicoli stradali	4,51
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	3,90
Assicurazione	3,73
Servizi sanitari e sociali	3,41
Forniture per ufficio e informatica	2,51
Petrolio	2,33
Prodotti chimici	2,25
Holding e società finanziarie	2,20
Trasporto	2,07
Servizi di pubblica utilità	2,07
Tessile e abbigliamento	1,95
Alberghi e ristoranti	1,81
Arti grafiche ed editoria	1,63
Costruzione di macchine e apparecchi	1,56
Materiali per l'edilizia e commercio	1,48
Società immobiliari	1,48
Comunicazioni	1,46
Servizi vari	0,67
Fondi di investimento	0,22
Metalli e pietre preziose	0,21
<b>Totale</b>	<b>96,77</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>3,23</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global  
Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre  
2022)**

## onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

### Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>150.166.854,60</b>
Portafoglio titoli a valore di mercato	2b	145.576.316,44
<i>Prezzo di costo</i>	2f	145.100.359,94
Depositi bancari		862.173,26
Credito per garanzia	10	989.000,00
Sottoscrizioni da incassare		1.349.595,20
Plusvalenza netta non realizzata su contratti forward sui cambi	2b	321.902,62
Plusvalenza netta non realizzata su swap	2b	592.943,53
Dividendi da incassare, netti	2c	67.780,25
Interessi da incassare, netti	2c	373.352,36
Oneri di costituzione, netti	2i	33.790,94
<b>Passività</b>		<b>4.151.292,94</b>
Scoperti bancari		1.367,52
Garanzie da versare	10	782.599,20
Debiti su investimenti acquistati		2.780.693,25
Debiti per riscatti		60.974,39
Commissioni di gestione dovute	3	369.424,00
Commissioni dovute a Depositario, Amministrazione Centrale e Agenti per il pagamento	4.5	68.627,45
Imposta di sottoscrizione dovuta ("Taxe d'abonnement")	9	18.232,16
Debiti su cambi		3.632,60
Altre passività		65.742,37
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>146.015.561,66</b>



## onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

### Conto economico e variazioni delle attività nette dal 11/10/22 al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Proventi</b>		<b>1.588.476,52</b>
Dividendi netti	2c	570.475,97
Interessi su obbligazioni e strumenti del mercato monetaria, netti	2c	747.739,52
Interessi ricevuti su swap		246.369,59
Interessi bancari sui conti correnti		21.536,52
Altri proventi		2.354,92
<b>Oneri</b>		<b>976.724,13</b>
Commissioni di gestione e di consulenza	3	636.007,98
Commissioni del Depositario, dell'Amministrazione Centrale e degli Agenti per il pagamento	4.5	118.553,85
Ammortamento degli oneri di costituzione	2i	10.212,50
Commissioni di transazione	6	26.362,93
Imposta di sottoscrizione ("Taxe d'abonnement")	9	34.488,38
Interessi bancari sugli scoperti		7.857,58
Interessi pagati su swap		53.463,72
Altri oneri	2g	89.777,19
<b>Utile / (perdita) netto(a) da investimenti</b>		<b>611.752,39</b>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
- vendite di portafoglio titoli	2d	-116.421,44
- contratti di cambio a termine	2b	490.363,40
- swap	2b	-473.593,66
- cambi	2h	-569.258,13
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a)</b>		<b>-57.157,44</b>
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
- portafoglio titoli	2b	475.956,50
- contratti di cambio a termine	2b	321.902,62
- swap	2b	592.943,53
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette a seguito delle operazioni</b>		<b>1.333.645,21</b>
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		144.681.916,45
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>146.015.561,66</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>146.015.561,66</b>

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>146.015.561,66</b>
<b>A - EUR</b>		
Numero di azioni		756.673,110
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,42
<b>AD - EUR</b>		
Numero di azioni		339.112,767
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,42
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		141.835,501
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,22
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		77.272,659
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,22
<b>M - EUR</b>		
Numero di azioni		30.166,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,42
<b>MD - EUR</b>		
Numero di azioni		62.449,595
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,43
<b>O - EUR</b>		
Numero di azioni		4.746,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,81
<b>OD - EUR</b>		
Numero di azioni		11.062,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,69
<b>U - EUR</b>		
Numero di azioni		277,130
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	101,39
<b>UD - EUR</b>		
Numero di azioni		463,911
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,48
<b>E - EUR</b>		
Numero di azioni		2.000,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,99

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Valori mobiliari ammessi alla quotazione ufficiale in una borsa valori e/o negoziati su un altro mercato regolamentato</b>			<b>140.865.439,96</b>	<b>96,47</b>
<b>Azioni</b>			<b>50.851.843,00</b>	<b>34,83</b>
<b>Australia</b>			<b>1.413.106,68</b>	<b>0,97</b>
APA GROUP STAPLED SECURITY	AUD	19.140	113.158,39	0,08
AURIZON HOLDINGS LTD	AUD	60.330	144.291,40	0,10
BLUESCOPE STEEL	AUD	14.607	183.144,51	0,13
BRAMBLES	AUD	14.032	123.368,59	0,08
FORTESCUE METALS GROUP LTD	AUD	17.605	238.242,16	0,16
MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES	AUD	37.479	51.679,40	0,04
QUANTAS AIRWAYS LTD	AUD	46.120	174.462,48	0,12
RIO TINTO	AUD	2.059	144.079,75	0,10
SONIC HEALTHCARE LTD	AUD	6.520	141.498,72	0,10
STOCKLAND	AUD	40.337	99.181,28	0,07
<b>Austria</b>			<b>229.473,03</b>	<b>0,16</b>
ERSTE GROUP BANK AG	EUR	3.791	121.653,19	0,08
OMV AG	EUR	2.776	107.819,84	0,07
<b>Belgio</b>			<b>105.833,00</b>	<b>0,07</b>
ELIA SYSTEM OPERATOR SA	EUR	910	105.833,00	0,07
<b>Bermuda</b>			<b>248.971,18</b>	<b>0,17</b>
ARCH CAPITAL GROUP LTD	USD	859	58.933,23	0,04
CREDICORP	USD	855	115.703,21	0,08
ORIENT OVERSEAS INTL	HKD	6.047	74.334,74	0,05
<b>Canada</b>			<b>1.543.232,75</b>	<b>1,06</b>
BRP CON VOTO SUBORDINATO WHEN ISSUED	CAD	1.400	108.600,12	0,07
CANADIAN UTILITIES -A- NON VOTING	CAD	4.267	101.406,64	0,07
EMPIRE -A- SENZA DIRITTO DI VOTO	CAD	4.800	125.111,87	0,09
FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS CON VOTO SUBORD..VTG	CAD	100	68.732,42	0,05
GEORGE WESTON	CAD	1.200	130.182,17	0,09
HYDRO ONE LTD	CAD	4.100	107.491,17	0,07
IGM FINANCIAL INC	CAD	3.967	110.818,81	0,08
LOBLAW COMPANIES	CAD	1.400	117.608,92	0,08
LUNDIN MINING (SEK)	CAD	15.900	114.318,76	0,08
NORTHLAND POWER INC	CAD	5.100	97.605,46	0,07
NUTRIEN - AZIONE NOMINATIVA	CAD	2.500	135.433,26	0,09
TFI INTERNATIONAL INC NOMINATIVA	CAD	700	73.180,72	0,05
TOROMONT INDUSTRIES LTD	CAD	1.575	118.727,75	0,08
WEST FRASER TIMBER CO	CAD	1.700	134.014,68	0,09
<b>Isole Cayman</b>			<b>1.107.128,42</b>	<b>0,76</b>
AUTOHOME -A- SPONS ADR REPR 4 SH-A-	USD	2.875	76.842,35	0,05
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	HKD	143.500	106.747,61	0,07
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	HKD	79.000	117.903,55	0,08
CK ASSET HOLDINGS LTD	HKD	21.141	107.315,98	0,07
DAQO NEW ENERGY SPONS ADR REPR 5 SHS	USD	3.170	115.351,97	0,08
HAITIAN INTERNATIONAL	HKD	52.000	111.180,51	0,08
LI AUTO - SHS A SPON ADR REPR 2 SHS A	USD	2.907	93.524,93	0,06
MEITUAN - SHS 114A/REG S	HKD	291	4.162,64	0,00
NETEASE INC	HKD	7.859	140.271,99	0,10
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	HKD	72.414	121.117,72	0,08
TENCENT	HKD	2.906	112.709,17	0,08
<b>Cina</b>			<b>925.874,28</b>	<b>0,63</b>
BYD COMPANY LTD -H-	HKD	2.533	74.066,93	0,05
CHINA CONSTRUCTION BANK CORPORATION -H-	HKD	114.856	68.109,98	0,05

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
CHINA TOWER	HKD	748.000	76.114,95	0,05
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD -H-	HKD	102.676	84.785,73	0,06
PICC GRP CN -H-	HKD	348.000	115.597,04	0,08
PICC PROPERTY AND CASUALTY -H-	HKD	94.756	96.532,60	0,07
TRAVELSKY TECHNOLOGY -H-	HKD	68.000	105.781,49	0,07
TSINGTAO BREWERY -H-	HKD	18.000	149.900,00	0,10
ZTE CORPORATION -H-	HKD	42.200	154.985,56	0,11
<b>Curacao</b>			<b>194.453,97</b>	<b>0,13</b>
SLB	USD	4.319	194.453,97	0,13
<b>Danimarca</b>			<b>766.149,14</b>	<b>0,52</b>
A.P. MOELLER-MAERSK -A-	DKK	73	116.471,37	0,08
A.P. MOELLER-MAERSK A/S -B-	DKK	70	112.577,98	0,08
CARLSBERG AS -B-	DKK	786	115.113,99	0,08
NOVO NORDISK	DKK	2.858	421.985,80	0,29
<b>Finlandia</b>			<b>649.474,46</b>	<b>0,44</b>
NESTE	EUR	3.453	121.752,78	0,08
ORION CORPORATION (NEW) -B-	EUR	3.210	122.044,20	0,08
SAMPO OYJ -A-	EUR	2.630	108.145,60	0,07
STORA ENSO -R-	EUR	28.003	297.531,88	0,20
<b>Francia</b>			<b>1.084.905,29</b>	<b>0,74</b>
AXA SA	EUR	5.989	161.852,73	0,11
DANONE SA	EUR	2.346	131.704,44	0,09
EIFFAGE	EUR	1.488	142.223,04	0,10
IPSEN	EUR	988	108.877,60	0,07
LVMH	EUR	143	123.409,00	0,08
SANOFI	EUR	1.803	177.054,60	0,12
SODEXO SA	EUR	942	95.000,70	0,07
VINCI SA	EUR	1.361	144.783,18	0,10
<b>Germania</b>			<b>397.857,32</b>	<b>0,27</b>
BASF SE PREFERENTIAL SHARE	EUR	3.038	135.099,86	0,09
MERCEDES-BENZ GROUP	EUR	1.978	145.719,26	0,10
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	EUR	493	117.038,20	0,08
<b>Hong Kong</b>			<b>459.154,12</b>	<b>0,31</b>
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD -RC-	HKD	35.000	116.056,70	0,08
BYD ELECTRONIC -RC-	HKD	42.000	116.425,14	0,08
CSPC PHARMACEUTICAL	HKD	138.000	109.919,65	0,08
FAR EAST HORIZON LTD	HKD	161.000	116.752,63	0,08
<b>Ungheria</b>			<b>110.788,31</b>	<b>0,08</b>
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC-A-	HUF	13.830	110.788,31	0,08
<b>Irlanda</b>			<b>527.578,58</b>	<b>0,36</b>
ACCENTURE - SHS CLASS A	USD	402	113.702,25	0,08
LINDE PLC	USD	682	238.218,66	0,16
TRANE TECH - REGISTERED SHS	USD	1.002	175.657,67	0,12
<b>Israele</b>			<b>512.328,48</b>	<b>0,35</b>
BANK HAPUALIM (IL662577)	ILS	13.450	100.925,25	0,07
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	USD	988	113.760,37	0,08
ICL GROUP LTD	ILS	18.830	93.483,75	0,06
WIX.COM LTD	USD	1.192	85.483,12	0,06
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	USD	10.450	118.675,99	0,08
<b>Italia</b>			<b>315.759,09</b>	<b>0,22</b>
POSTE ITALIANE SPA	EUR	10.851	107.598,52	0,07
SNAM SPA	EUR	21.813	104.418,83	0,07
TERNA SPA	EUR	13.290	103.741,74	0,07

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Giappone</b>			<b>1.238.154,09</b>	<b>0,85</b>
ASTELLAS PHARMA	JPY	4.000	54.512,81	0,04
CHUGAI PHARMACEUTICAL	JPY	1.000	25.911,98	0,02
DISCO CO LTD	JPY	314	45.022,79	0,03
FUJI ELECTRIC SHS	JPY	1.881	75.031,15	0,05
HONDA MOTOR CO LTD	JPY	6.400	176.186,22	0,12
MARUBENI CORP	JPY	4.639	71.782,14	0,05
MAZDA MOTOR CORP	JPY	1.400	12.371,92	0,01
mitsubishi heavy industries ltd	JPY	2.250	95.757,31	0,07
OBAYASHI CORP	JPY	9.580	75.576,73	0,05
ORACLE CORP JAPAN	JPY	537	36.404,42	0,02
RENASAS ELECTRONICS	JPY	29.800	510.532,53	0,35
TOKYO ELECTRON LTD	JPY	453	59.064,09	0,04
<b>Lussemburgo</b>			<b>126.068,28</b>	<b>0,09</b>
TENARIS SA - REG.SHS	EUR	9.192	126.068,28	0,09
<b>Messico</b>			<b>471.548,38</b>	<b>0,32</b>
ALFA SAB DE CV -A-	MXN	187.600	106.777,76	0,07
ARCA CONTINENT	MXN	12.300	115.655,97	0,08
COCA-COLA FEMSA --- UNITS CONS OF 5 SHS	MXN	13.320	101.854,80	0,07
CONTROLADORA AXTEL SAB DE C	MXN	187.600	2.225,79	0,00
GMEXICO -B-	MXN	32.930	145.034,06	0,10
<b>Paesi Bassi</b>			<b>1.662.432,78</b>	<b>1,14</b>
ASML HOLDING NV	EUR	703	466.089,00	0,32
CNH INDUSTRIAL REG SHS (USD)	EUR	20.276	267.744,58	0,18
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	4.738	148.109,88	0,10
LYONDELLBASELL -A-	USD	1.570	132.147,66	0,09
NN GROUP NV	EUR	3.412	115.700,92	0,08
NXP SEMICONDUCTORS	USD	935	175.413,20	0,12
OCI REG.SHS	EUR	6.215	136.543,55	0,09
STELLANTIS --- BEARER AND REGISTERED SHS	EUR	4.227	68.012,43	0,05
STMICROELECTRONICS	EUR	3.351	152.671,56	0,10
<b>Nuova Zelanda</b>			<b>84.233,10</b>	<b>0,06</b>
SPARK NEW	NZD	29.470	84.233,10	0,06
<b>Norvegia</b>			<b>379.401,98</b>	<b>0,26</b>
AKER BP SHS	NOK	7.169	154.438,48	0,11
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	NOK	8.416	123.700,12	0,08
YARA INTERNATIONAL ASA	NOK	3.123	101.263,38	0,07
<b>Portogallo</b>			<b>143.388,44</b>	<b>0,10</b>
JERONIMO MARTINS SGPS SA	EUR	5.681	143.388,44	0,10
<b>Singapore</b>			<b>345.061,29</b>	<b>0,24</b>
CAPITALAND ASCE UNITS	SGD	56.700	104.452,42	0,07
SINGAPORE AIRLINES LTD	SGD	26.300	127.358,62	0,09
SINGAPORE EXCHANGE LTD	SGD	17.400	113.250,25	0,08
<b>Sudafrica</b>			<b>436.021,20</b>	<b>0,30</b>
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	ZAR	2.302	95.077,35	0,07
FIRSTRAND LTD	ZAR	40.400	134.272,34	0,09
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	ZAR	15.355	93.365,16	0,06
KUMBA IRON ORE	ZAR	5.277	113.306,35	0,08
<b>Spagna</b>			<b>748.675,79</b>	<b>0,51</b>
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	EUR	19.534	137.363,09	0,09
BANCO SANTANDER SA REG SHS	EUR	26.945	91.208,83	0,06
ENAGAS	EUR	5.681	102.258,00	0,07
IBERDROLA SA	EUR	6.251	74.699,45	0,05

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
INDITEX SHARE FROM SPLIT	EUR	3.670	130.138,20	0,09
NATURGY ENERGY GROUP SA	EUR	3.852	105.005,52	0,07
REDEIA CORPORACION SA	EUR	7.020	108.002,70	0,07
<b>Svezia</b>			<b>270.085,24</b>	<b>0,18</b>
HENNES AND MAURITZ AB	SEK	9.286	145.922,01	0,10
TELEFON ERICSSON	SEK	25.050	124.163,23	0,09
<b>Svizzera</b>			<b>1.912.749,86</b>	<b>1,31</b>
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	CHF	25	287.895,09	0,20
CHUBB - NAMEN AKT	USD	1.077	190.089,02	0,13
CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	CHF	918	142.630,71	0,10
COCA COLA HBC SA	GBP	2.736	74.764,55	0,05
GARMIN	USD	1.026	98.076,57	0,07
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	CHF	441	119.597,05	0,08
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	CHF	1.298	143.091,85	0,10
NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE	CHF	2.591	238.911,94	0,16
ROCHE HOLDING AG	CHF	373	112.199,99	0,08
ROCHE HOLDING LTD	CHF	1.008	282.452,74	0,19
UBS GROUP NAMEN-AKT	CHF	3.554	65.887,64	0,05
ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	CHF	361	157.152,71	0,11
<b>Regno Unito</b>			<b>1.808.070,44</b>	<b>1,24</b>
3I GROUP PLC	GBP	5.668	128.696,59	0,09
ANGLO AMERICAN PLC	GBP	3.922	102.054,72	0,07
AON PREFERENTIAL SHARE	USD	598	189.211,37	0,13
ASTRAZENECA PLC	GBP	751	98.680,60	0,07
BARCLAYS PLC	GBP	27.205	48.624,40	0,03
BT GROUP PLC	GBP	34.031	48.519,41	0,03
BURBERRY GROUP PLC	GBP	3.502	86.514,48	0,06
GSK REG SHS	GBP	8.300	134.324,30	0,09
HARGREAVES LANS - REGISTERED SHS	GBP	8.796	83.598,65	0,06
HSBC HOLDINGS PLC (USD 0.5)	GBP	12.679	91.854,97	0,06
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	GBP	1.111	70.351,03	0,05
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	GBP	27.660	73.263,63	0,05
LIBERTY GLOBAL -A-	USD	6.286	97.142,03	0,07
LIBERTY GLOBAL -C-	USD	6.798	110.724,53	0,08
LLOYDS BANKING GROUP PLC	GBP	223.793	113.676,36	0,08
RIO TINTO PLC	GBP	2.229	129.495,78	0,09
SSE PLC	GBP	9.385	201.337,59	0,14
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>30.633.884,03</b>	<b>20,98</b>
3M CO	USD	2.134	195.776,41	0,13
ABBOTT LABORATORIES	USD	1.828	182.665,96	0,13
ABBVIE INC	USD	2.001	247.107,91	0,17
ADOBE INC	USD	544	243.822,69	0,17
AFLAC INC	USD	2.505	160.264,89	0,11
AIRBNB INC	USD	1.232	144.723,30	0,10
ALPHABET INC -A-	USD	2.777	304.680,93	0,21
ALPHABET INC -C-	USD	2.641	292.833,89	0,20
AMAZON.COM INC	USD	5.894	704.254,67	0,48
AMERICAN FINANCIAL GROUP	USD	1.255	136.600,60	0,09
AMERICAN INTL	USD	3.058	161.280,77	0,11
AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	504	153.445,13	0,11
AMGEN INC	USD	997	202.890,87	0,14
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	USD	9.834	180.365,11	0,12
APPLE INC	USD	10.196	1.812.757,21	1,24
APPLIED MATERIALS INC	USD	1.524	201.905,55	0,14
ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	USD	2.005	138.861,41	0,10
AT&T INC	USD	13.035	190.566,68	0,13

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
AUTODESK INC	USD	563	105.587,01	0,07
AUTOZONE INC	USD	56	127.981,81	0,09
BAKER HUGHES RG-A REGISTERED SHS -A-	USD	6.103	176.824,78	0,12
BANK OF AMERICA CORP	USD	3.948	103.820,46	0,07
BEST BUY CO INC	USD	1.515	113.798,58	0,08
BIOGEN IDEC INC	USD	463	120.885,01	0,08
BOOKING HOLDINGS INC	USD	61	150.980,87	0,10
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	3.766	220.747,66	0,15
BROADCOM INC - REGISTERED SHS	USD	415	329.957,33	0,23
C.H.ROBINSON WORLWIDE INC	USD	1.716	148.400,18	0,10
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	USD	56	12.037,69	0,01
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	USD	1.481	148.466,52	0,10
CARDINAL HEALTH	USD	1.502	130.196,28	0,09
CARRIER GLOBAL CORP-WI	USD	3.928	178.974,23	0,12
CATERPILLAR - REGISTERED	USD	972	219.212,28	0,15
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	USD	2.102	133.749,62	0,09
CHENIERE ENERGY INC	USD	1.003	140.070,65	0,10
CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	USD	61	119.595,78	0,08
CISCO SYSTEMS INC	USD	9.523	451.622,38	0,31
COCA-COLA CO	USD	3.888	214.606,20	0,15
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	USD	2.413	144.381,89	0,10
COMCAST CORP	USD	5.150	196.134,28	0,13
CONSOLIDATED EDISON INC	USD	1.194	98.934,56	0,07
COSTCO WHOLESALE CORP	USD	262	129.290,16	0,09
CSX CORP	USD	6.128	191.535,11	0,13
CVS HEALTH	USD	3.083	195.350,86	0,13
DANAHER CORP	USD	127	27.937,67	0,02
DARDEN RESTAURANTS INC	USD	694	106.281,87	0,07
DISCOVER FINANCIAL SERVICES - SHS WI	USD	1.426	152.729,70	0,10
DOVER CORP	USD	1.276	172.686,89	0,12
DOW - REGISTERED SHS	USD	2.762	134.834,21	0,09
DROPBOX INC	USD	6.666	162.953,46	0,11
ELEVANCE HEALTH	USD	444	180.810,96	0,12
ELI LILLY & CO	USD	380	163.347,75	0,11
EQUITABLE HOLDINGS INC	USD	6.274	156.188,67	0,11
EXPEDIA GROUP INC	USD	1.153	115.606,48	0,08
FIFTH THIRD BANCORP	USD	1.747	41.969,63	0,03
FORD MOTOR	USD	5.938	82.348,25	0,06
FORTINET	USD	2.219	153.743,55	0,11
FORTIVE CORPORATION	USD	2.569	176.062,45	0,12
GARTNER INC	USD	413	132.610,48	0,09
GENERAL MILLS INC	USD	1.834	128.934,74	0,09
GENUINE PARTS CO	USD	716	111.062,03	0,08
GILEAD SCIENCES INC	USD	2.529	178.652,64	0,12
GLOBE LIFE INC	USD	1.289	129.514,37	0,09
GODADDY -A-	USD	1.381	95.100,39	0,07
HALLIBURTON	USD	5.298	160.202,58	0,11
HILTON WORLDWIDE HLDGS INC REG SHS	USD	694	92.586,34	0,06
HOME DEPOT INC	USD	437	124.426,84	0,09
HOST HOTELS & RESORTS - SHS	USD	8.254	127.327,97	0,09
HP ENTERPRISE CO	USD	31.336	482.534,19	0,33
HUMANA INC	USD	317	129.917,70	0,09
INTEL CORP	USD	3.585	109.883,04	0,08
INTUIT	USD	382	160.429,50	0,11
JOHNSON & JOHNSON	USD	4.557	691.360,81	0,47
JPMORGAN CHASE CO	USD	1.813	241.689,02	0,17
KEYCORP	USD	15.661	132.637,62	0,09
KIMBERLY-CLARK CORP	USD	1.096	138.692,72	0,09

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
KLA CORPORATION	USD	386	171.601,94	0,12
KROGER CO	USD	2.752	118.555,45	0,08
LAM RESEARCH CORP	USD	288	169.700,90	0,12
LENNAR CORP -A-	USD	798	91.656,63	0,06
LKQ CORP	USD	2.213	118.195,70	0,08
LOWE'S CO INC	USD	945	195.496,33	0,13
MARATHON PETROLEUM	USD	1.521	162.556,00	0,11
MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	USD	810	136.378,46	0,09
MASTERCARD INC -A-	USD	1.045	376.717,23	0,26
MCDONALD'S CORP	USD	850	232.491,75	0,16
MERCK & CO INC	USD	3.127	330.728,26	0,23
META PLATFORMS INC A	USD	4.058	1.067.428,82	0,73
METLIFE INC	USD	3.143	162.854,07	0,11
MICROCHIP TECHNOLOGY	USD	2.002	164.398,88	0,11
MICRON TECHNOLOGY INC	USD	2.600	150.399,63	0,10
MICROSOFT CORP	USD	5.581	1.742.029,09	1,19
MID-AMER APARTMENT COMMUNITIES INC	USD	379	52.754,30	0,04
MOLINA HEALTHCARE	USD	456	125.907,83	0,09
MOSAIC	USD	3.947	126.622,36	0,09
NETAPP	USD	1.226	85.853,71	0,06
NORFOLK SOUTHERN	USD	795	165.237,58	0,11
NVIDIA CORP	USD	1.529	592.848,38	0,41
NVR INC	USD	14	81.492,83	0,06
ON SEMICONDUCTOR CORP	USD	1.791	155.263,78	0,11
O REILLY AUTO	USD	154	134.845,28	0,09
OTIS WORLDWIDE CORPORATION	USD	2.099	171.248,39	0,12
OWENS CORNING SHS	USD	1.449	173.322,18	0,12
PACCAR INC	USD	2.348	180.027,68	0,12
PAYPAL HOLDINGS	USD	3.080	188.385,33	0,13
PEPSICO INC	USD	697	118.330,28	0,08
PFIZER INC	USD	8.725	293.339,14	0,20
PHILLIPS 66	USD	1.596	139.529,31	0,10
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	USD	1.318	152.155,91	0,10
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	USD	2.015	140.071,13	0,10
PROCTER & GAMBLE CO	USD	2.600	361.616,87	0,25
PUBLIC STORAGE INC	USD	229	61.265,37	0,04
QORVO INC	USD	983	91.929,87	0,06
QUALCOMM INC	USD	1.634	178.287,22	0,12
REGIONS FINANCIAL CORP	USD	8.442	137.888,58	0,09
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	USD	2.095	144.441,70	0,10
SIMON PROPERTY GROUP - NOMINATIVA	USD	1.240	131.251,33	0,09
SKYWORKS SOLUTIONS INC	USD	1.039	105.414,22	0,07
SNAP ON INC	USD	645	170.378,14	0,12
SPLUNK INC	USD	793	77.112,16	0,05
STARBUCKS CORP	USD	1.890	171.607,15	0,12
STEEL DYNAMICS	USD	1.426	142.377,80	0,10
SYNCHRONY FINANCIAL	USD	5.394	167.703,46	0,11
SYNOPSIS	USD	401	160.036,12	0,11
TARGA RESOURCES CORP	USD	1.802	125.694,04	0,09
TARGET CORP	USD	626	75.682,31	0,05
TERADYNE INC	USD	1.325	135.208,30	0,09
TESLA MOTORS INC	USD	2.740	657.424,20	0,45
TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	1.454	239.916,66	0,16
THE CIGNA GROUP - REGISTERED SHS	USD	241	61.984,05	0,04
THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	USD	2.104	138.891,00	0,10
THERMO FISHER SCIENT SHS	USD	39	18.651,01	0,01
TRAVELERS COS INC/THE	USD	849	135.139,63	0,09
TYSON FOODS INC -A-	USD	2.660	124.442,16	0,09



# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
ULTA BEAUTY RG PREFERENTIAL SHARE	USD	303	130.696,87	0,09
UNION PACIFIC CORP	USD	1.349	253.008,60	0,17
UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	1.019	448.920,40	0,31
UNITED RENTALS INC	USD	407	166.146,28	0,11
US BANCORP	USD	22.069	668.340,75	0,46
VALERO ENERGY CORP	USD	1.404	150.952,52	0,10
VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	2.726	92.923,87	0,06
VISA INC -A-	USD	928	201.999,49	0,14
WALMART INC	USD	733	105.603,06	0,07
WALT DISNEY CO	USD	277	22.667,79	0,02
WASTE MANAGEMENT	USD	992	157.683,45	0,11
WELLS FARGO AND CO	USD	5.841	228.500,35	0,16
WESTROCK	USD	4.753	126.645,01	0,09
WEYERHAEUSER CO	USD	4.088	125.562,68	0,09
YUM BRANDS INC	USD	777	98.674,01	0,07
YUM CHINA HOLDINGS INC WI	USD	2.012	104.196,15	0,07
ZILLOW GROUP -C-	USD	2.509	115.584,18	0,08
<b>Obbligazioni</b>			<b>90.013.596,96</b>	<b>61,65</b>
<b>Australia</b>			<b>909.603,92</b>	<b>0,62</b>
AUSTRALIA 4.50 13-33 21/04S	AUD	1.436.000	909.603,92	0,62
<b>Francia</b>			<b>5.285.743,20</b>	<b>3,62</b>
FRANCIA 0.10 16-28 01/03A	EUR	340.000	389.030,44	0,27
FRANCIA 0.10 21-32 01/03A	EUR	60.000	65.718,06	0,05
FRANCIA 0.1 14-25 01/03A	EUR	4.214.715	4.830.994,70	3,31
<b>Germania</b>			<b>14.380.038,07</b>	<b>9,85</b>
GERMANIA 0.10 15-26 15/04A	EUR	122.000	147.296,44	0,10
GERMANIA 0.50 14-30 15/04A	EUR	120.000	151.551,13	0,10
GERMANY 1.8 22-53 15/08A	EUR	1.900.000	1.663.478,50	1,14
GERMANIA 2.3 23-33 15/02A	EUR	1.900.000	1.885.237,00	1,29
GERMANIA 2.40 23-28 19/10A	EUR	3.410.000	3.385.107,00	2,32
GERMANY 2.85 23-25 12/06A	EUR	7.200.000	7.147.368,00	4,89
<b>Italia</b>			<b>3.931.670,99</b>	<b>2,69</b>
ITALIA 0.65 20-26 15/05S	EUR	40.000	45.267,49	0,03
ITALIA 1.30 16-28 15/05S	EUR	140.000	168.039,30	0,12
ITALIA 3.4 22-28 01/04S	EUR	1.760.000	1.736.292,80	1,19
ITALIA 4.35 23-33 01/11S	EUR	1.930.000	1.982.071,40	1,36
<b>Giappone</b>			<b>8.259.817,08</b>	<b>5,66</b>
GIAPPONE 0.100 23-28 03/20S	JPY	210.000.000	1.334.369,77	0,91
GIAPPONE 0.2000 23-28 20/03S	JPY	510.000.000	3.256.508,59	2,23
JAPAN 0.5 23-33 20/03S	JPY	265.300.000	1.699.196,50	1,16
GIAPPONE 1.4000 23-53 20/03S	JPY	299.850.000	1.969.742,22	1,35
<b>Regno Unito</b>			<b>10.580.060,08</b>	<b>7,25</b>
REGNO UNITO 0.125 12-24 22/03S	GBP	3.544.464	6.227.027,44	4,26
REGNO UNITO 0.125 18/28 21/06S	GBP	230.000	344.042,37	0,24
REGNO UNITO 1.625 18-28 22/10S	GBP	1.520.000	1.521.797,82	1,04
REGNO UNITO 3.25 23-33 31/01S	GBP	2.340.000	2.487.192,45	1,70
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>46.666.663,62</b>	<b>31,96</b>
STATI UNITI 0.625 22-32 15/07S	USD	300.000	263.374,64	0,18
STATI UNITI 1.125 23-33 15/10S	USD	1.100.000	981.934,45	0,67
STATI UNITI 1.25 23-28 15/04S	USD	3.970.000	3.555.323,01	2,43
STATI UNITI 1.625 22-27 15/10S	USD	4.708.300	4.348.343,49	2,98
STATI UNITI 3.375 23-33 15/05S	USD	5.200.000	4.585.672,58	3,14
UNITED STATES 3.5 23-33 15/02S	USD	2.856.600	2.544.691,23	1,74
STATI UNITI 3.625 23-28 31/05S	USD	7.390.000	6.615.904,27	4,53

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
STATI UNITI 3.625 23-53 15/02S	USD	2.630.400	2.307.589,84	1,58
STATI UNITI 3.625 23-53 15/05S	USD	4.520.000	3.969.824,14	2,72
STATI UNITI 4.0 23-28 30/06S	USD	6.500.000	5.916.178,52	4,05
STATI UNITI 4.25 23-25 31/05S	USD	5.410.000	4.893.863,48	3,35
STATI UNITI 4.625 23-25 30/06S	USD	7.330.000	6.683.963,97	4,58
<b>Strumenti del mercato monetario</b>			<b>2.652.917,29</b>	<b>1,82</b>
<b>Mercato dei Titoli di Stato</b>			<b>2.652.917,29</b>	<b>1,82</b>
<b>Belgio</b>			<b>2.057.279,10</b>	<b>1,41</b>
UNIONE EUROPEA ZCP 081223	EUR	2.090.000	2.057.279,10	1,41
<b>Francia</b>			<b>595.638,19</b>	<b>0,41</b>
FRANCIA ZCP 130923	EUR	600.000	595.638,19	0,41
<b>Organismi di investimento collettivo</b>			<b>2.057.959,19</b>	<b>1,41</b>
<b>Azioni/quote di fondi di investimento</b>			<b>2.057.959,19</b>	<b>1,41</b>
<b>Irlanda</b>			<b>2.057.959,19</b>	<b>1,41</b>
PIMCO EUR SH MT - ACC ETF EUR	EUR	7.000	676.382,00	0,46
PIMCO TRENDS MANAGED FUT STRAT FD	EUR	126.056	1.381.577,19	0,95
<b>Totale portafoglio titoli</b>			<b>145.576.316,44</b>	<b>99,70</b>
<b>Depositi bancari/(saldi passivi)</b>			<b>1.819.805,74</b>	<b>1,25</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>			<b>-1.380.560,52</b>	<b>-0,95</b>
<b>Totale attività nette</b>			<b>146.015.561,66</b>	<b>100,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

---

### Ripartizione geografica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Paese</b>	<b>% delle attività nette</b>
Stati Uniti d'America	52,94
Germania	10,12
Regno Unito	8,48
Giappone	6,50
Francia	4,77
Italia	2,91
Irlanda	1,77
Australia	1,59
Belgio	1,48
Svizzera	1,31
Paesi Bassi	1,14
Canada	1,06
Isole Cayman	0,76
Cina	0,63
Danimarca	0,52
Spagna	0,51
Finlandia	0,45
Israele	0,35
Messico	0,32
Hong Kong	0,31
Sudafrica	0,30
Norvegia	0,26
Singapore	0,24
Svezia	0,19
Bermuda	0,17
Austria	0,16
Curacao	0,13
Portogallo	0,10
Lussemburgo	0,09
Ungheria	0,08
Nuova Zelanda	0,06
<b>Totale</b>	<b>99,70</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>0,30</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

---

### Ripartizione economica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

Settore	% delle attività nette
Obbligazioni di Stati, province e comuni	62,05
Internet e servizi Internet	3,85
Prodotti farmaceutici e cosmetici	3,15
Elettronica e semiconduttori	2,80
Banche e altre istituzioni finanziarie	2,39
Forniture per ufficio e informatica	2,27
Holding e società finanziarie	2,05
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	1,83
Assicurazione	1,69
Fondi di investimento	1,41
Organizzazioni sovranazionali	1,41
Trasporto	1,39
Costruzione di macchine e apparecchi	1,17
Cibi e bevande non alcoliche	1,17
Veicoli stradali	1,13
Petrolio	1,07
Servizi di pubblica utilità	0,98
Comunicazioni	0,79
Società immobiliari	0,71
Prodotti chimici	0,70
Servizi sanitari e sociali	0,70
Alberghi e ristoranti	0,69
Servizi vari	0,63
Miniere di carbone e industria siderurgica	0,49
Materiali per l'edilizia e commercio	0,49
Carta e prodotti forestali	0,48
Metalli non ferrosi	0,41
Beni di consumo vari	0,38
Metalli e pietre preziose	0,29
Ingegneria elettrica ed elettronica	0,20
Tabacco e bevande alcoliche	0,18
Imballaggi	0,16
Arti grafiche ed editoria	0,15
Biotecnologie	0,12
Servizi ambientali e riciclo	0,11
Industria aeronautica e aerospaziale	0,08
Agricoltura e pesca	0,07
Tessile e abbigliamento	0,06
<b>Totale</b>	<b>99,70</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>0,30</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global  
Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>329.089,90</b>
Sottoscrizioni da incassare		329.089,90
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>329.089,90</b>

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		329.089,90
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>329.089,90</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>329.089,90</b>

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>329.089,90</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		2.407,049
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		883,850
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00



**onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global  
Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno  
2023)**

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>232.732,50</b>
Sottoscrizioni da incassare		232.732,50
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>232.732,50</b>

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		232.732,50
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>232.732,50</b>
Attività nette all'inizio del periodo		-
Attività nette alla fine del periodo		<b>232.732,50</b>

# onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>232.732,50</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		2.081,900
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		245,425
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00

**onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan  
Emerging Countries Fund (lanciato il  
30 settembre 2022)**

## onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

---

### Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	Nota	Importi in euro
<b>Attività</b>		<b>243.743.147,74</b>
Portafoglio titoli a valore di mercato	2b	240.392.884,45
<i>Prezzo di costo</i>	2f	241.176.450,00
Depositi bancari		1.597.752,76
Sottoscrizioni da incassare		542.078,57
Dividendi da incassare, netti	2c	1.176.845,72
Oneri di costituzione, netti	2i	33.586,24
<b>Passività</b>		<b>758.640,28</b>
Debiti per riscatti		18.158,23
Commissioni di gestione dovute	3	466.866,40
Commissioni dovute a Depositario, Amministrazione Centrale e Agenti per il pagamento	4.5	180.130,38
Imposta di sottoscrizione dovuta ("Taxe d'abonnement")		10.818,38
Altre passività		82.666,89
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>242.984.507,46</b>

## onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

### Conto economico e variazioni delle attività nette dal 30/09/22 al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Proventi</b>		<b>3.186.171,14</b>
Dividendi netti	2c	3.154.270,97
Interessi bancari sui conti correnti		31.045,40
Altri proventi		854,77
<b>Oneri</b>		<b>1.844.966,05</b>
Commissioni di gestione e di consulenza	3	960.527,30
Commissioni del Depositario, dell'Amministrazione Centrale e degli Agenti per il pagamento	4.5	361.126,52
Ammortamento degli oneri di costituzione	2i	10.690,18
Commissioni di transazione	6	373.263,22
Imposta di sottoscrizione ("Taxe d'abonnement")	9	25.903,88
Interessi bancari sugli scoperti		2.178,90
Altri oneri	2g	111.276,05
<b>Utile / (perdita) netto(a) da investimenti</b>		<b>1.341.205,09</b>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
- vendite di portafoglio titoli	2d	2.295.469,23
- contratti di cambio a termine	2b	14.155,59
- cambi	2h	-1.328.501,25
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a)</b>		<b>2.322.328,66</b>
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
- portafoglio titoli	2b	-783.565,55
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette a seguito delle operazioni</b>		<b>1.538.763,11</b>
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		241.445.744,35
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>242.984.507,46</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>242.984.507,46</b>

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>242.984.507,46</b>
<b>A - EUR</b>		
Numero di azioni		261.612,474
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	101,13
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		42.608,890
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,94
<b>M - EUR</b>		
Numero di azioni		74.422,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	101,08
<b>MD - EUR</b>		
Numero di azioni		92.299,034
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	101,17
<b>O - EUR</b>		
Numero di azioni		1.789,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	101,42
<b>OD - EUR</b>		
Numero di azioni		4.909,000
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	101,53
<b>U - EUR</b>		
Numero di azioni		259,880
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	107,09
<b>UD - EUR</b>		
Numero di azioni		31,679
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,64
<b>D - EUR</b>		
Numero di azioni		194.007,541
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	102,89
<b>E - EUR</b>		
Numero di azioni		1.649.598,772
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	105,90



# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
<b>Valori mobiliari ammessi alla quotazione ufficiale in una borsa valori e/o negoziati su un altro mercato regolamentato</b>			<b>226.321.205,96</b>	<b>93,14</b>
<b>Azioni</b>			<b>226.321.205,96</b>	<b>93,14</b>
<b>Bermuda</b>			<b>2.102.993,21</b>	<b>0,87</b>
CHINA RESOURCES	HKD	145.500	456.086,18	0,19
CREDICORP	USD	4.792	648.479,27	0,27
GENPACT LTD	USD	18.323	630.976,27	0,26
KUNLUN ENERGY	HKD	510.000	367.451,49	0,15
<b>Brasile</b>			<b>13.272.805,06</b>	<b>5,46</b>
AMBEV ADR REPR 1 SHS	USD	192.270	560.420,35	0,23
ATACADAO SA	BRL	139.614	297.107,51	0,12
B3 REG SHS	BRL	418.904	1.162.870,50	0,48
BANCO BTG PACTUAL SA	BRL	28.953	173.013,84	0,07
BANCO DO BRASIL SA	BRL	104.177	977.834,66	0,40
BB SEGURIDADE	BRL	48.029	280.800,37	0,12
BRADESCO --- SHS SPONSORED ADR	USD	154.532	426.344,01	0,18
CEMIG ADR REPR 1 PFD SH	USD	73.004	175.985,81	0,07
ELETRORBRAS (CENTR.ELET.BRASIL.) PREF.-B-	BRL	23.775	201.114,00	0,08
GERDAU PFD SHS/SPONS.ADR REPR. 1 PFD SH.	USD	30.300	144.973,42	0,06
ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU SA-PREF	BRL	194.468	356.198,27	0,15
ITAU UNIBANCO ADR REPR 1 PFD SHS	USD	242.792	1.312.990,65	0,54
LOCALIZA RENT A CAR SA	BRL	65.238	849.098,04	0,35
LOJAS RENNER	BRL	190.044	722.188,87	0,30
NATURA CO HLDG -REGISTERED SHS	BRL	29.796	94.772,00	0,04
PETROBRAS BR PREFERENTIAL SHARE	BRL	27.157	93.137,73	0,04
PETROLEO BRASILEIRO SP.ADR REPR.2 SH	USD	191.128	2.422.823,32	1,00
PORTO SEGURO SA	BRL	37.204	198.779,49	0,08
RAIA DROGASIL SA	BRL	169.125	951.187,54	0,39
RUMO SA	BRL	34.469	145.394,60	0,06
SABESP	BRL	9.429	101.348,76	0,04
SENDAS DISTRIB - REGISTERED SHS	BRL	25.918	67.712,81	0,03
SLC AGRICOLA SA	BRL	13.255	96.258,05	0,04
SUZANO SA	BRL	9.466	79.533,82	0,03
TAESA - CTF CONS OF 2 PFD SHS + 1 SH	BRL	28.892	206.630,23	0,09
TELEF BRASIL	BRL	12.039	98.979,20	0,04
TIM - REGISTERED SHS	BRL	50.199	139.446,97	0,06
TOTVS	BRL	13.516	76.992,15	0,03
WEG SA	BRL	119.741	858.868,09	0,35
<b>Isole Vergini britanniche</b>			<b>202.876,72</b>	<b>0,08</b>
ARCOS DORADOS HOLDINGS INC A	USD	21.594	202.876,72	0,08
<b>Canada</b>			<b>91.408,52</b>	<b>0,04</b>
B2GOLD CORP	CAD	27.959	91.408,52	0,04
<b>Isole Cayman</b>			<b>37.556.179,23</b>	<b>15,46</b>
3SBIO UNITARY 144A/REG S	HKD	90.000	82.845,01	0,03
AIRTAC INTL	TWD	21.000	633.486,03	0,26
ALIBABA GROUP	HKD	310.600	2.949.895,32	1,21
ANTA SPORTS PRODUCTS	HKD	41.800	391.369,29	0,16
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	HKD	64.500	582.029,19	0,24
BAIDU INC -A- ADR REPR 8 SH -A-	USD	3.811	478.243,82	0,20
BUDWEISER BREWING COMPANY APAC LIMITED	HKD	1.125.900	2.660.114,39	1,09
CHINA LESSO GROUP	HKD	159.000	95.589,32	0,04
CHINA MENGNIU DAIRY	HKD	304.000	1.048.925,69	0,43
CHINA RESOURCES LAND LTD -RC-	HKD	188.000	730.037,31	0,30
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES	HKD	146.000	664.280,62	0,27

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDG LTD	HKD	666.000	695.624,41	0,29
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	HKD	60.600	691.785,68	0,28
GREENTOWN MANAGEMENT	HKD	75.000	54.563,32	0,02
H WORLD GP LTD	HKD	153.400	542.750,04	0,22
JD.COM INC - CL A	HKD	128.300	1.986.843,98	0,82
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	HKD	71.700	414.700,52	0,17
JS GLOBAL LIFES --- REGISTERED SHS	HKD	87.000	13.839,08	0,01
KANZHUN LTD SHS A SPONSORED US DEPOSITAR	USD	42.689	588.881,26	0,24
KE HOLDINGS INC	HKD	46.500	211.568,83	0,09
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO	HKD	603.000	739.141,72	0,30
MEITUAN - SHS 114A/REG S	HKD	112.690	1.611.984,86	0,66
MINTH GROUP LTD	HKD	160.000	402.353,30	0,17
NETEASE INC	HKD	172.700	3.082.449,68	1,27
NEW HORIZON HEALTH LTD	HKD	44.000	140.753,48	0,06
NU HLDG --- REGISTERED SHS -A-	USD	23.419	169.363,80	0,07
PARADE TECHNOLOGIES LTD	TWD	14.000	442.925,19	0,18
PINDUODUO	USD	12.954	820.934,52	0,34
SEA -A- ADR REPR1 SHS	USD	4.138	220.137,05	0,09
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	HKD	54.000	472.121,83	0,19
SILERGY CORP	TWD	47.000	532.540,29	0,22
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY (GRP) CO LTD	HKD	14.200	129.797,54	0,05
TENCENT	HKD	188.600	7.314.848,47	3,01
TINGY HOLDING CORP	HKD	392.000	558.447,66	0,23
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDING	HKD	369.000	293.052,39	0,12
TRIP COM GROUP LTD	HKD	26.150	833.770,78	0,34
VIPSHOP HOLDINGS ADR 1/5 REPR	USD	7.369	111.446,84	0,05
WANT WANT CHINA	HKD	1.539.000	936.032,84	0,39
WUXI BIOLOGICS	HKD	195.500	858.629,54	0,35
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	HKD	282.000	402.400,08	0,17
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	HKD	1.128.000	1.194.006,81	0,49
YIHAI INTL UNITARY 144A/REGS	HKD	30.000	58.879,26	0,02
ZHEN DING TEH	TWD	3.000	9.270,53	0,00
ZJLD GROUP IN	HKD	104.000	95.610,37	0,04
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	HKD	26.450	607.907,29	0,25
<b>Cile</b>			<b>937.387,98</b>	<b>0,39</b>
BANCO DE CHILE	CLP	829.003	79.277,39	0,03
BANCO SANTANDER CHILE SPONS -1039- ADR	USD	43.505	751.667,51	0,31
CENCOSUD SA	CLP	59.948	106.443,08	0,04
<b>Cina</b>			<b>23.220.943,54</b>	<b>9,56</b>
ANGANG STEEL COMPANY -H-	HKD	730.000	175.035,38	0,07
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-H	HKD	11.800	121.316,54	0,05
BYD COMPANY LTD -H-	HKD	5.000	146.203,96	0,06
CHANGSHA ZOOMLION -H-	HKD	1.022.000	484.122,25	0,20
CHINA CITIC BANK CORPORATION LTD -H-	HKD	223.000	95.984,65	0,04
CHINA CONSTRUCTION BANK CORPORATION -H-	HKD	1.816.000	1.076.893,93	0,44
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD -H-	HKD	531.000	2.211.024,95	0,91
CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) CO LTD	HKD	333.400	789.659,29	0,32
CHINA PETROLEUM AND CHEMICAL CORP -H-	HKD	3.438.000	1.845.727,92	0,76
CHINA RAILWAY GROUP LTD -H-	HKD	1.367.000	826.624,33	0,34
CHINA VANKE -H-	HKD	109.700	134.980,64	0,06
CITIC SECURITIES CO -H-	HKD	172.000	285.670,84	0,12
CMOC GROUP LIMITED	HKD	168.000	80.564,23	0,03
CRRG CORP -H- SHS -HCOMPANY	HKD	388.000	194.687,53	0,08
DONGFANG ELECTRIC -H-	HKD	427.200	500.665,99	0,21
FLAT GLASS GROUP -H-REGS.	HKD	73.000	228.399,83	0,09
FUYAO GLASS GRP 144A/REGS	HKD	258.400	979.234,36	0,40
GF SECURITIES UNITARY 144A/REG S	HKD	95.400	120.732,66	0,05

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
HAIER SMART HOME CO LTD - REG SHS -H-	HKD	1.508.000	4.347.778,28	1,79
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	HKD	14.500	75.724,88	0,03
INDUS.AND COMMERCIAL BANK OF CHINA -H-	HKD	432.000	211.207,41	0,09
JIANGXI COPPER -H-	HKD	37.000	52.104,75	0,02
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC-H-	HKD	79.000	249.020,43	0,10
NONGFU SPRING - REGISTERED SHS -H- UNI	HKD	643.400	3.254.739,93	1,34
PHARMARON BEIJING - REGISTERED SHS -H-	HKD	48.200	136.430,52	0,06
PICC PROPERTY AND CASUALTY -H-	HKD	398.000	405.462,18	0,17
PING AN INS (GRP) CO -H-	HKD	419.000	2.443.027,24	1,01
PSBC H UNITARY 144A/REGS	HKD	217.000	122.336,46	0,05
SINOPHARM GROUP CO LTD	HKD	44.000	126.086,30	0,05
SINOTRANS -H-	HKD	260.000	84.845,08	0,03
TSINGTAO BREWERY -H-	HKD	8.000	66.622,22	0,03
WUXI APPTec CO LTD.	HKD	74.000	540.954,65	0,22
ZHUZHOU CRRC -H-	HKD	134.700	460.044,21	0,19
ZIJIN MINING CORP CO LTD -H-	HKD	258.000	347.029,72	0,14
<b>Repubblica Ceca</b>			<b>88.465,75</b>	<b>0,04</b>
KOMERCNI BANKA AS	CZK	3.163	88.465,75	0,04
<b>Grecia</b>			<b>867.377,38</b>	<b>0,36</b>
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS S.A	EUR	69.147	103.720,50	0,04
HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANISATION	EUR	13.606	213.750,26	0,09
JUMBO SA REG.SHS	EUR	4.548	114.609,60	0,05
MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN.REG SHS	EUR	3.377	78.346,40	0,03
MYTILINEOS SA REG SHS	EUR	3.684	119.140,56	0,05
NATL BANK GREECE -REGISTERED SHS	EUR	23.281	138.615,07	0,06
PIRAEUS FIN HLG --- REGISTERED SHS	EUR	32.999	99.194,99	0,04
<b>Hong Kong</b>			<b>5.476.982,83</b>	<b>2,25</b>
AIA GROUP LTD	HKD	140.000	1.295.250,13	0,53
CHINA OVERSEAS LAND INVESTMENT LTD -RC-	HKD	262.500	524.404,37	0,22
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	HKD	1.170.000	933.295,91	0,38
GUANGDONG INVEST -RC-	HKD	238.000	188.179,70	0,08
HANG SENG BANK LTD	HKD	19.100	249.090,61	0,10
HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING LTD	HKD	30.800	1.063.447,84	0,44
LENOVO GROUP LTD	HKD	434.000	414.725,66	0,17
SINOTRUK HK	HKD	57.000	101.470,23	0,04
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	HKD	71.000	707.118,38	0,29
<b>Ungheria</b>			<b>711.483,57</b>	<b>0,29</b>
CHEMICAL WORKS OF GEDEON RICHTER PLC	HUF	5.231	118.083,16	0,05
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC-A-	HUF	15.078	120.785,69	0,05
OTP BANK LTD	HUF	14.533	472.614,72	0,19
<b>India</b>			<b>23.327.918,83</b>	<b>9,60</b>
DR REDDYS LABORATORIES ADR	USD	14.593	844.146,87	0,35
HOUSING DEVT FINANCE ADR REPR 3 SHS	USD	151.989	9.710.021,36	4,00
ICICI BANK ADR REPR.2 SHS	USD	264.910	5.604.145,55	2,31
INFOSYS TECHNOLOGIES ADR REPR.1 SHS	USD	234.294	3.451.058,28	1,42
TATA MOTORS LTD ADR REPR 5 SHS	USD	22.660	522.156,19	0,21
WIPRO ADR.REPR.1SHS	USD	694.829	3.006.042,97	1,24
WNS HOLDINGS SPONSORED ADR	USD	2.817	190.347,61	0,08
<b>Indonesia</b>			<b>5.638.533,74</b>	<b>2,32</b>
BANK CENTRAL ASIA DEP	IDR	2.789.200	1.560.277,82	0,64
BANK MANDIRI	IDR	617.800	196.404,95	0,08
BANK NEGARA INDONESIA	IDR	226.400	126.648,11	0,05
BANK RAKYAT INDONESIA	IDR	5.779.200	1.916.764,04	0,79
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	IDR	18.710.600	125.829,24	0,05
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUT	IDR	101.000	69.929,56	0,03

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione Valuta		Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
KALBE FARMA	IDR	688.200	86.252,11	0,04
PT UNILEVER INDONESIA TBK	IDR	229.000	59.641,19	0,02
SEMEN GRESIK (PERSERO) TBK	IDR	960.900	356.882,84	0,15
TELKOM INDONESIA -B-	IDR	4.661.300	1.139.903,88	0,47
<b>Lussemburgo</b>			<b>727.368,64</b>	<b>0,30</b>
ALLEGRO EU	PLN	36.590	264.148,99	0,11
GLOBALANT REG SHS	USD	2.812	463.219,65	0,19
<b>Malesia</b>			<b>933.524,61</b>	<b>0,38</b>
CELCOMDIGI BHD	MYR	71.700	57.870,27	0,02
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	MYR	91.900	91.318,88	0,04
HONG LEONG BANK BHD	MYR	19.700	73.349,83	0,03
IHH HEALTHCARE BHD	MYR	46.300	53.553,87	0,02
KUALA LUMPUR KEPONG MY	MYR	11.800	50.887,24	0,02
MALAYAN BANKING BHD	MYR	59.200	100.329,13	0,04
PETRONAS CHEMICALS	MYR	111.300	131.141,75	0,05
PRESS MTL ALUMI - REGISTERED	MYR	60.200	55.563,41	0,02
PUBLIC BANK BHD	MYR	422.600	319.510,23	0,13
<b>Messico</b>			<b>8.504.444,71</b>	<b>3,50</b>
AMERICA MOVIL SAB DE CV	MXN	532.179	529.016,28	0,22
ARCA CONTINENT	MXN	23.316	219.238,59	0,09
CEMEX-CPO REPR 2 SHS -A-,1 SHS -B-	MXN	158.392	102.427,59	0,04
COCA-COLA FEMSA --- UNITS CONS OF 5 SHS	MXN	10.954	83.762,58	0,03
FOMENTO ECONOMICO UNITS 1 SH-B- 4 SHS-D-	MXN	15.919	161.247,17	0,07
GENEREA	MXN	143.048	140.286,61	0,06
GRUPO AEROPORT CENT -B-	MXN	9.546	92.790,76	0,04
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB-B-	MXN	59.256	972.958,49	0,40
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE -B-	MXN	28.553	728.215,03	0,30
GRUPO FINANCIERO BANORTE -O-	MXN	246.501	1.860.297,91	0,77
INTACT FINANCIAL CORP	MXN	12.921	87.713,53	0,04
KIMBERLY-CLARK -A-	MXN	334.064	679.690,05	0,28
REGIONAL -REGISTERED SHS	MXN	30.487	202.071,37	0,08
VESTA	MXN	57.665	171.134,80	0,07
WAL MART	MXN	683.460	2.473.593,95	1,02
<b>Panama</b>			<b>146.156,15</b>	<b>0,06</b>
COPA HOLDINGS SA	USD	1.442	146.156,15	0,06
<b>Filippine</b>			<b>384.976,77</b>	<b>0,16</b>
AYALA LAND INC	PHP	138.500	55.885,07	0,02
BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS	PHP	33.572	60.652,11	0,02
BDO UNIBANK INC	PHP	37.476	85.689,37	0,04
INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SERVICE	PHP	16.390	55.465,50	0,02
SM INVESTMENTS CORP	PHP	4.210	64.664,15	0,03
SM PRIME HOLDINGS INC	PHP	114.800	62.620,57	0,03
<b>Polonia</b>			<b>1.661.462,94</b>	<b>0,68</b>
DINA POLSKA S.A.	PLN	6.342	679.318,60	0,28
GRUPA PEKAO SA	PLN	7.902	197.521,03	0,08
KRUK S.A.	PLN	1.207	111.097,42	0,05
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN	PLN	75.755	673.525,89	0,28
<b>Portogallo</b>			<b>589.530,68</b>	<b>0,24</b>
JERONIMO MARTINS SGPS SA	EUR	23.357	589.530,68	0,24
<b>Arabia Saudita</b>			<b>6.294.459,22</b>	<b>2,59</b>
ALDREES PETROLEUM AND TRANSP	SAR	4.009	121.680,79	0,05
ALINMA BANK	SAR	42.996	351.995,60	0,14
ALMARAI	SAR	14.849	220.267,42	0,09
AL RAJHI BANK	SAR	51.973	927.182,06	0,38

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
ARABIAN CONTRACTING SERVICES	SAR	3.720	161.818,18	0,07
ARABIAN DRILLING COM	SAR	6.021	226.596,77	0,09
ELM CO	SAR	1.429	203.244,87	0,08
ETIHAD ETISALAT	SAR	14.115	165.226,91	0,07
JARIR MARKETING COMPANY	SAR	20.270	81.932,01	0,03
LEEJAM SPORTS COMPANY	SAR	4.808	151.571,85	0,06
MOUWASAAT MEDICAL SERVICES COMPANY	SAR	6.888	407.354,84	0,17
NAHDI MEDICAL COMPANY	SAR	2.503	103.985,83	0,04
RIYAD BANK	SAR	32.225	264.997,86	0,11
RIYADH CABLES GROUP CO	SAR	12.210	195.145,16	0,08
SABIC AGRI-NUTRIENTS COMPANY	SAR	9.631	305.028,74	0,13
SAUDI AIRLINES CATERING COMPANY	SAR	5.037	121.616,72	0,05
SAUDI AWWAL BANK	SAR	19.956	186.051,17	0,08
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	SAR	21.472	462.812,90	0,19
SAUDI INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	SAR	8.502	76.563,71	0,03
SAUDI TELECOM COMPANY	SAR	40.594	431.534,46	0,18
THEEB RENT A CAR CO	SAR	4.377	81.935,04	0,03
THE SAUDI NATIONAL BANK	SAR	88.170	792.926,69	0,33
UNITED INTL TRANSPORTATION COMPANY LTD	SAR	14.104	252.989,64	0,10
<b>Sudafrica</b>			<b>8.569.317,75</b>	<b>3,53</b>
ABSA GRP --- REGISTERED SHS	ZAR	14.063	114.569,54	0,05
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	ZAR	3.944	38.082,59	0,02
ANGLOGOLD ASHANTI LTD-REG.SHS	ZAR	4.144	79.979,25	0,03
ANGLOVAAL INDUSTRIES LTD	ZAR	67.317	222.393,82	0,09
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS PLC	ZAR	10.723	95.532,45	0,04
BID CORPORATION LIMITED	ZAR	48.315	968.838,78	0,40
BIDVEST GROUP	ZAR	40.270	511.191,71	0,21
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	ZAR	12.275	933.759,65	0,38
CLICKS GROUP	ZAR	41.240	522.824,68	0,22
FIRSTRAND LTD	ZAR	460.945	1.531.984,29	0,63
GOLD FIELDS	ZAR	11.791	149.681,94	0,06
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	ZAR	9.553	58.086,44	0,02
MR.PRICE GROUP	ZAR	12.396	86.728,43	0,04
MTN GROUP LTD	ZAR	94.190	631.350,20	0,26
NASPERS -N-	ZAR	3.465	571.437,89	0,24
SANLAM LTD	ZAR	169.351	479.449,93	0,20
SHOPRITE HOLDINGS LTD (SHP)	ZAR	21.415	234.407,66	0,10
SIBANYE STILLWATER LTD	ZAR	33.827	47.596,62	0,02
STANDARD BANK GROUP LIMITED	ZAR	68.096	586.620,06	0,24
THE FOSCHINI GROUP LTD	ZAR	15.698	71.610,91	0,03
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	ZAR	28.440	78.101,73	0,03
VODACOM GROUP	ZAR	84.919	482.888,78	0,20
WOOLWORTHS HOLDINGS	ZAR	20.856	72.200,40	0,03
<b>Corea del Sud</b>			<b>30.193.742,32</b>	<b>12,43</b>
AFREECATV CO LTD	KRW	2.813	143.237,26	0,06
BGF RETAIL - REGISTERED	KRW	3.422	416.336,99	0,17
CJ CHEILJEDANG	KRW	1.039	194.782,30	0,08
COWAY CO LTD	KRW	3.909	119.508,76	0,05
DAEDUCK ELECTRONICS CO LTD	KRW	6.573	147.458,07	0,06
DB INSURANCE RG REGISTERED SHS	KRW	1.573	81.628,67	0,03
DOOSAN ENGINE CO LTD	KRW	14.080	99.119,33	0,04
EO TECHNICS	KRW	1.890	147.118,43	0,06
EUGENETECH	KRW	7.649	180.908,41	0,07
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	KRW	5.484	71.108,01	0,03
HAESUNG DS --- REGISTERED SHS	KRW	1.908	80.431,50	0,03
HANA FINANCIAL GROUP INC	KRW	37.605	1.025.431,95	0,42
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO. LTD.	KRW	12.999	311.059,57	0,13

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
HANON SYSTEMS	KRW	26.020	165.616,49	0,07
HL MANDO CO. LTD	KRW	1.775	66.552,18	0,03
HUGEL INC	KRW	3.437	262.994,94	0,11
HYUNDAI ENGINEERING CONSTRUCTION	KRW	4.096	108.557,57	0,04
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	KRW	1.891	260.059,89	0,11
HYUNDAI MOBIS	KRW	5.156	833.894,38	0,34
HYUNDAI MOTOR CO LTD	KRW	4.461	640.807,32	0,26
INDUST BK OF KOREA	KRW	23.162	166.598,77	0,07
JYP ENTERTAINMENT CORP REGISTERED SHS	KRW	6.213	565.306,89	0,23
KAKAOBANK CORP	KRW	3.460	57.162,98	0,02
KB FINANCIAL GROUP INC	KRW	38.393	1.275.265,49	0,52
K CAR CO LTD	KRW	16.674	174.098,76	0,07
KIA CORPORATION	KRW	20.879	1.285.369,97	0,53
KIWOOM	KRW	3.778	232.321,50	0,10
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	KRW	5.006	179.686,62	0,07
KOREA KUMHO PETROCHEMICAL	KRW	1.322	122.033,08	0,05
LG CHEM	KRW	4.254	1.973.778,90	0,81
LG ENERGY SOLUTION - REG SHS	KRW	405	155.795,65	0,06
LG H&H	KRW	1.352	431.682,62	0,18
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	KRW	579	62.267,76	0,03
NAVER	KRW	5.237	665.938,23	0,27
NCSOFT	KRW	3.386	694.838,95	0,29
NEXON GAMES CO LTD	KRW	5.033	79.299,48	0,03
ORION PREFERENTIAL SHARE	KRW	1.238	103.342,05	0,04
POSCO HOLDINGS INC.	KRW	1.866	503.638,07	0,21
POSCO INTERNATIONAL	KRW	6.174	171.147,33	0,07
S.M.ENTERTAINMENT	KRW	1.771	131.572,46	0,05
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	KRW	1.069	553.255,61	0,23
SAMSUNG C&T	KRW	1.549	113.894,19	0,05
SAMSUNG ELEC GDR REP.0.5 VGT HS -144A-	USD	6.892	8.755.556,37	3,60
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	KRW	4.856	488.114,50	0,20
SAMSUNG ENGINEERING	KRW	6.311	124.239,53	0,05
SAMSUNG FIRE AND MARINE INSURANCE	KRW	1.842	294.708,49	0,12
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	KRW	3.161	147.983,99	0,06
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	KRW	1.962	49.133,39	0,02
SHINHAN FINANCIAL GROUP	KRW	29.715	702.796,90	0,29
SK CO LTD	KRW	4.357	295.809,80	0,12
SK HYNIX INC	KRW	34.891	2.796.025,18	1,15
SK IE TECH --- REGISTERED SHS	KRW	1.034	69.625,94	0,03
SK INNOVATION	KRW	2.626	289.533,73	0,12
SK TELEKOM	KRW	8.986	291.291,30	0,12
S-OIL CORP	KRW	9.280	430.575,18	0,18
ST PHARM --- REGISTERED SHS	KRW	1.470	78.635,54	0,03
STX PAN OCEAN	KRW	29.157	105.062,51	0,04
YG ENTERTAINMENT INC	KRW	2.427	129.828,88	0,05
YUHAN CORP	KRW	2.140	89.913,71	0,04
<b>Taiwan</b>			<b>40.378.249,21</b>	<b>16,62</b>
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	TWD	123.000	1.263.352,13	0,52
ADVANTECH CO LTD	TWD	164.000	1.976.476,41	0,81
ASE TECH HLDG -REGISTERED SHS	TWD	204.000	663.416,59	0,27
ASIA VITAL COMPONENTS CO LTD	TWD	18.000	143.560,74	0,06
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	TWD	6.000	186.293,45	0,08
ASPEED TECHNOLOGY	TWD	10.000	838.761,99	0,35
AUO CORPORATION	TWD	237.000	129.734,41	0,05
CATHAY FINANCIAL	TWD	317.000	402.563,08	0,17
CHAILEASE HOLDING COMPANY LTD	TWD	127.000	762.478,79	0,31
CHINA STEEL CORP	TWD	725.000	627.305,68	0,26

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

## Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
CHINATRUST FINANCIAL HLDGS	TWD	812.000	593.849,37	0,24
CHUNGHWA TELECOM	TWD	85.000	291.433,00	0,12
DELTA ELECTRONIC INCS	TWD	205.000	2.078.437,49	0,86
E.SUN FINANCIAL HOLDING	TWD	840.000	643.992,62	0,27
ECLAT TEXTILE CO LTD	TWD	41.000	602.716,71	0,25
EMEMORY TECH	TWD	3.000	195.122,53	0,08
FARADAY TECHNOLOGY	TWD	45.000	279.440,18	0,12
FENG TAY ENTERPRISE	TWD	19.000	109.877,82	0,05
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	TWD	614.000	1.523.315,38	0,63
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	414.000	740.794,59	0,30
GIANT MANUFACTURE CO LTD	TWD	73.000	494.133,82	0,20
GIGA-BYTE TECHNOLOGY CO	TWD	26.000	186.322,88	0,08
GLOBAL UNICHIPO CORP	TWD	13.000	614.062,07	0,25
HON HAI PRECISION IND	TWD	330.000	1.097.453,84	0,45
LARGAN PRECISION CO LTD	TWD	7.000	438.804,96	0,18
MAKALOT INDUSTRIAL CO LTD	TWD	60.000	533.276,04	0,22
MEDIA TEK INCORPORATION	TWD	33.000	668.184,29	0,27
MEGA FINANCIAL HOLDING COMPANY	TWD	370.000	415.967,09	0,17
MICRO-STAR INTERNATIONAL	TWD	52.000	270.110,79	0,11
MOMO.COM INC	TWD	2.000	40.496,02	0,02
NAN YA PLASTICS CORP	TWD	157.000	334.989,77	0,14
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	TWD	22.000	221.756,90	0,09
NOVATEK ELECTRONICS	TWD	99.000	1.242.647,96	0,51
NUVOTON TECHNOLOGY CORP	TWD	26.000	98.326,45	0,04
POYA CO LTD	TWD	4.000	69.690,82	0,03
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	TWD	110.000	914.544,87	0,38
QUANTA COMPUTER INC	TWD	141.000	630.749,01	0,26
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	TWD	75.000	855.316,50	0,35
TAIWAN CEMENT CORP	TWD	137.000	153.415,45	0,06
TAIWAN SEMICONDUCTOR CO ADR (REPR 5 SHS)	USD	145.723	13.479.711,42	5,55
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	TWD	83.000	429.917,02	0,18
UNI PRESIDENT ENTERPRISES CORP	TWD	201.000	451.351,07	0,19
UNITED MICROELECTRONICS CORP	TWD	424.000	605.203,56	0,25
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	TWD	274.000	709.622,07	0,29
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	TWD	2.000	115.660,86	0,05
WISTRON CORP	TWD	95.000	253.865,29	0,10
WIWYNN CORPORATION	TWD	17.000	710.446,12	0,29
YAGEO CORPORATION	TWD	20.000	289.299,31	0,12
<b>Thailandia</b>			<b>5.006.480,25</b>	<b>2,06</b>
ADVANCED INFO SERVICE -F-	THB	33.400	184.781,32	0,08
AIRPORT OF THAILAND PUB CO -F-	THB	131.700	245.141,08	0,10
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PUBLIC CO	THB	212.800	152.662,52	0,06
BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC	THB	8.700	50.830,63	0,02
CENTRAL PATTANA PUBLIC CO NVDR LTD	THB	53.100	89.915,31	0,04
CP AXTRA PUBLIC COMPANY LIMITED	THB	59.700	55.175,74	0,02
CP SEVEN ELEVEN ALL FOREIGN REGISTERED	THB	98.700	159.475,87	0,07
DELTA ELECTRONIC - UNITS NON VOTING	THB	55.200	131.287,91	0,05
ENERGY ABSOLUTE NVDR	THB	1.500	2.210,36	0,00
GULF ENERGY DEVELOPMENT PUBLIC	THB	66.000	79.767,02	0,03
INTOUCH HOLDINGS PUBLIC CO LTD	THB	32.400	61.983,28	0,03
KASIKORNBANK UNITS NVDR	THB	67.300	225.311,13	0,09
KRUNG THAI BANK PUBLIC NVTG DEPO CO LTD	THB	608.600	305.233,01	0,13
PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PUBLIC CO	THB	386.200	1.497.619,01	0,62
PTT GLOBAL CHEM SHS FOREIGN REGISTER	THB	183.900	177.094,81	0,07
PTT -REGISTERED	THB	192.900	167.060,91	0,07
SCB X PCL-FOREIGN	THB	275.700	759.074,13	0,31
SIAM CEMENT FOREIGN REGISTERED	THB	60.200	501.129,74	0,21

*Le note integrative costituiscono parte integrante del presente bilancio.*

## onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

### Prospetto degli investimenti e delle altre attività al 30/06/23

Denominazione	Valuta	Quantità/ Nozionale	Valore di mercato (in EUR)	% delle attività nette
THAI OIL-FOREIGN REG	THB	140.500	160.726,47	0,07
<b>Emirati Arabi Uniti</b>			<b>152.660,89</b>	<b>0,06</b>
AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC	SAR	145.615	152.660,89	0,06
<b>Regno Unito</b>			<b>4.512.202,59</b>	<b>1,86</b>
AIRTEL AFRICA PLC	GBP	33.110	41.592,47	0,02
ANGLO AMERICAN PLC	GBP	45.997	1.196.892,16	0,49
HSBC HOLDINGS PLC (USD 0.5)	HKD	35.600	253.997,22	0,10
RIO TINTO PLC	GBP	2.440	141.754,01	0,06
UNILEVER	GBP	60.274	2.877.966,73	1,18
<b>Stati Uniti d'America</b>			<b>4.771.272,87</b>	<b>1,96</b>
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	USD	9.487	603.654,94	0,25
COUPANG INC	USD	7.755	123.681,94	0,05
EPAM SYSTEMS	USD	2.469	508.623,05	0,21
EXLSERVICE HOLDING	USD	1.786	247.289,79	0,10
KOSMOS ENERGY LTD	USD	50.962	279.800,53	0,12
MERCADOLIBRE	USD	1.181	1.282.321,36	0,53
SOUTHERN COPPER CORP	USD	3.747	246.388,43	0,10
YUM CHINA HOLDINGS INC WI	USD	28.569	1.479.512,83	0,61
<b>Organismi di investimento collettivo</b>			<b>14.071.678,49</b>	<b>5,79</b>
<b>Azioni/quote di fondi di investimento</b>			<b>14.071.678,49</b>	<b>5,79</b>
<b>Irlanda</b>			<b>12.072.915,05</b>	<b>4,97</b>
JPM ETF IRL GLB EM RES ENH INDX EQ ESG	USD	474.736	12.072.915,05	4,97
<b>Lussemburgo</b>			<b>1.998.763,44</b>	<b>0,82</b>
JPML EUR LIQ LVNAV X FLEX DIS	EUR	200	1.998.763,44	0,82
<b>Totale portafoglio titoli</b>			<b>240.392.884,45</b>	<b>98,93</b>
<b>Depositi bancari/(saldi passivi)</b>			<b>1.597.752,76</b>	<b>0,66</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>			<b>993.870,25</b>	<b>0,41</b>
<b>Totale attività nette</b>			<b>242.984.507,46</b>	<b>100,00</b>



## onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

---

### Ripartizione geografica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

<b>Paese</b>	<b>% delle attività nette</b>
Taiwan	16,62
Isole Cayman	15,46
Corea del Sud	12,43
India	9,60
Cina	9,56
Brasile	5,46
Irlanda	4,97
Sudafrica	3,53
Messico	3,50
Arabia Saudita	2,59
Indonesia	2,32
Hong Kong	2,25
Thailandia	2,06
Stati Uniti d'America	1,96
Regno Unito	1,86
Lussemburgo	1,12
Bermuda	0,86
Polonia	0,68
Cile	0,39
Malesia	0,38
Grecia	0,36
Ungheria	0,29
Portogallo	0,24
Filippine	0,16
Isole Vergini britanniche	0,08
Emirati Arabi Uniti	0,06
Panama	0,06
Canada	0,04
Repubblica Ceca	0,04
<b>Totale</b>	<b>98,93</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>1,07</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

---

### Ripartizione economica delle partecipazioni al 30/06/23 (non certificata)

Settore	% delle attività nette
Banche e altre istituzioni finanziarie	15,27
Elettronica e semiconduttori	14,00
Internet e servizi Internet	11,55
Holding e società finanziarie	6,40
Cibi e bevande non alcoliche	5,85
Fondi di investimento	5,79
Ingegneria elettrica ed elettronica	5,50
Petrolio	4,07
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	3,80
Assicurazione	2,95
Veicoli stradali	2,37
Prodotti farmaceutici e cosmetici	2,06
Forniture per ufficio e informatica	2,06
Comunicazioni	1,92
Prodotti chimici	1,64
Trasporto	1,60
Costruzione di macchine e apparecchi	1,41
Alberghi e ristoranti	1,29
Materiali per l'edilizia e commercio	1,27
Società immobiliari	1,09
Biotecnologie	0,86
Miniere di carbone e industria siderurgica	0,82
Tessile e abbigliamento	0,82
Metalli non ferrosi	0,78
Beni di consumo vari	0,66
Servizi di pubblica utilità	0,53
Arti grafiche ed editoria	0,41
Tabacco e bevande alcoliche	0,36
Servizi sanitari e sociali	0,36
Carta e prodotti forestali	0,31
Servizi vari	0,30
Fotografia e ottica	0,23
Metalli e pietre preziose	0,18
Pneumatici e gomma	0,13
Industria aeronautica e aerospaziale	0,10
Imballaggi	0,09
Agricoltura e pesca	0,06
Istituzioni non classificabili/non classificate	0,04
<b>Totale</b>	<b>98,93</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>1,07</b>
<b>Totale attività nette</b>	<b>100,00</b>

**onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan US  
Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>461.755,00</b>
Sottoscrizioni da incassare		461.755,00
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>461.755,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

### Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		461.755,00
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>461.755,00</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>461.755,00</b>

# onemarkets Fund - onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>461.755,00</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		4.617,550
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00

**onemarkets Fund - onemarkets Allianz Global  
Equity Future Champions Fund (lanciato il  
30 giugno 2023)**

# onemarkets Fund - onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>495.126,00</b>
Sottoscrizioni da incassare		495.126,00
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>495.126,00</b>



# onemarkets Fund - onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		495.126,00
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>495.126,00</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>495.126,00</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>495.126,00</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		4.931,360
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00
<b>UD - EUR</b>		
Numero di azioni		19,900
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00

**onemarkets Fund - onemarkets Allianz  
Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il  
30 giugno 2023)**

## onemarkets Fund - onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

### Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>115.383,70</b>
Sottoscrizioni da incassare		115.383,70
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>115.383,70</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

### Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		115.383,70
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>115.383,70</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>115.383,70</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>115.383,70</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		441,925
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		711,912
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00

**onemarkets Fund - onemarkets Pictet Global  
Opportunities Allocation Fund (lanciato il  
30 giugno 2023)**

# onemarkets Fund - onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>939.097,70</b>
Sottoscrizioni da incassare		939.097,70
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>939.097,70</b>



# onemarkets Fund - onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		939.097,70
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>939.097,70</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>939.097,70</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>939.097,70</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		7.375,595
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		2.015,382
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00

**onemarkets Fund - onemarkets Global  
Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno  
2023)**

# onemarkets Fund - onemarkets Global Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>319.068,00</b>
Sottoscrizioni da incassare		319.068,00
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>319.068,00</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Global Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

### Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		319.068,00
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>319.068,00</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>319.068,00</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Global Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>319.068,00</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		2.458,580
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		732,100
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00

**onemarkets Fund - onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

# onemarkets Fund - onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>43.430,00</b>
Sottoscrizioni da incassare		43.430,00
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>43.430,00</b>



# onemarkets Fund - onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		43.430,00
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>43.430,00</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>43.430,00</b>

# onemarkets Fund - onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

## Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>43.430,00</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		434,300
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00

**onemarkets Fund - onemarkets Multi-Asset Value  
Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

## onemarkets Fund - onemarkets Multi-Asset Value Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

### Prospetto integrato delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Attività</b>		<b>176.822,30</b>
Sottoscrizioni da incassare		176.822,30
<b>Valore patrimoniale netto</b>		<b>176.822,30</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Multi-Asset Value Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

### Conto economico e variazioni delle attività nette al 30/06/23

	<i>Nota</i>	<i>Importi in euro</i>
<b>Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) su:</b>		
<b>Variazioni di plusvalenze/ (minusvalenze) nette non realizzate su:</b>		
Sottoscrizioni / Riscatti di quote, netti		176.822,30
<b>Incremento / (diminuzione) netto/a delle attività nette</b>		<b>176.822,30</b>
<b>Attività nette all'inizio del periodo</b>		<b>-</b>
<b>Attività nette alla fine del periodo</b>		<b>176.822,30</b>

## onemarkets Fund - onemarkets Multi-Asset Value Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

---

### Informazioni statistiche

		30/06/23
<b>Totale attività nette</b>	<b>EUR</b>	<b>176.822,30</b>
<b>C - EUR</b>		
Numero di azioni		1.002,242
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00
<b>CD - EUR</b>		
Numero di azioni		765,981
Valore patrimoniale netto per azione	EUR	100,00

**onemarkets Fund**

**Nota integrativa - Prospetto degli  
strumenti finanziari derivati**

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

Al 30 giugno 2023 erano in essere i seguenti contratti di opzione:

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni acquistate</b>					
<b>Opzioni su azioni</b>					
15,00	TOTAL SA SEP 58.000 15.09.23 CALL	EUR	-	673,20	-2.524,70
249,00	AEGON NV DE SEP 4.000 15.09.23 PUT	EUR	-	1.743,00	-6.068,00
28,00	OCI SEP 32.000 15.09.23 CALL	EUR	-	308,00	-4.294,08
2,00	AURUBIS AG DEC 100.000 15.12.23 CALL	EUR	-	196,00	-1.484,00
34,00	ENEL SEP 6.400 15.09.23 CALL	EUR	-	829,60	-1.305,50
193,00	NOKIA SEP 4.400 15.09.23 CALL	EUR	-	772,00	-6.429,00
12,00	NEOEN SA DEC 41.540 15.12.23 CALL	EUR	-	142,56	-2.776,81
23,00	ENCAVIS AG DEC 20.000 15.12.23 CALL	EUR	-	552,00	-4.722,00
13,00	RED ELECTRICA DEC 17.000 15.12.23 CALL	EUR	-	247,00	-744,90
29,00	NORDEX SE DEC 16.000 15.12.23 CALL	EUR	-	609,00	-5.510,00
13,00	TAL EDUCATION DEC 36.000 15.12.23 CALL	EUR	-	169,00	-3.065,00
1.126,00	BANCO DE SABAD SEP 0.800 15.09.23 PUT	EUR	-	2.252,00	-4.132,42
93,00	NIBE INDUSTRIE DEC 170.00 15.12.23 CALL	SEK	-	497,19	-2.004,63
14,00	BASF DEC 56.000 15.12.23 CALL	EUR	-	392,00	-1.274,00
9,00	LANXESS AG DEC 48.000 15.12.23 CALL	EUR	-	36,00	-4.140,00
6,00	ADECCO REG.SHS SEP 37.000 15.09.23 CALL	CHF	-	6,15	-799,66
31,00	NESTE DEC 55.690 15.12.23 CALL	EUR	-	217,00	-5.605,00
11,00	ARCELORMITTAL SEP 30.000 15.09.23 CALL	EUR	-	121,00	-1.906,00
14,00	UMICORE DEC 38.000 15.12.23 CALL	EUR	-	56,00	-2.282,00
5,00	NEXANS SA DEC 110.00 15.12.23 CALL	EUR	-	250,00	-2.177,00
31,00	FORTUM OYJ DEC 20.000 15.12.23 CALL	EUR	-	31,00	-1.023,00
24,00	BARCLAYS RG SEP 2.100 15.09.23 CALL	GBP	-	349,59	-1.410,85
49,00	AEGON NV DE DEC 5.600 15.12.23 CALL	EUR	-	294,00	-1.225,00
<b>Opzioni su valute</b>					
2.400.000,00	FXO NZDUSD C 0.62 UBSWDE24XXX 07/08/2023	NZD	-	9.787,32	-406,10
1.000.000,00	FXO AUDNZD C 1.095 GOLDDEFAXXX 12/07/2023	AUD	-	1.418,24	-955,36
1.200.000,00	FXO USDCHF P 0.8935 MSEDEFBFXO 19/07/2023	USD	-	7.113,97	-1.547,30
2.100.000,00	FXO USDINR C 85.7 CCFRFRPPXXX 11/08/2023	USD	-	108,91	-2.626,11
2.000.000,00	FXO USDHKD C 7.766 MSEDEFBFXO 28/03/2024	USD	-	9.470,47	-609,25
900.000,00	FXO GBPUSD P 1.2 SBILDEFFQFX 24/10/2023	GBP	-	4.243,31	-6.867,49
900.000,00	FXO EURGBP C 0.865 SOGEFRPPHCM 05/07/2023	EUR	-	1.813,46	-814,54
2.300.000,00	FXO USDCAD C 1.4 ROYCGB2LXXX 31/10/2023	USD	-	3.224,89	-14.328,24
1.500.000,00	FXO GBPUSD P 1.242 GOLDDEFAXXX 06/09/2023	GBP	-	10.554,05	-16.730,07
700.000,00	FXO USDJPY C 145 GOLDDEFAXXX 01/08/2023	USD	-	5.853,84	246,09
1.200.000,00	FXO USDCHF C 0.8935 MSEDEFBFXO 19/07/2023	USD	-	6.834,41	-1.826,86
1.200.000,00	FXO USDSGD C 1.34 UBSWDE24XXX 11/08/2023	USD	-	12.309,42	4.372,45
1.000.000,00	FXO CADJPY C 109.5 SBILDEFFQFX 10/07/2023	CAD	-	3.119,21	-155,48
4.200.000,00	FXO EURUSD P 1.09 SBILDEFFQFX	EUR	-	13.187,62	-18.605,12



# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su valute</b>					
1.200.000,00	FXO EURUSD C 1.0875 SOGEFRPPHCM 07/07/2023	EUR	-	13.790,39	-11.961,61
1.600.000,00	FXO USDJPY P 135 CCFRFRPPXXX 08/08/2023	USD	-	4.443,18	-13.984,22
700.000,00	FXO USDCNH P 6.95 SOGEFRPPHCM 28/08/2023	USD	-	529,33	-2.303,93
1.500.000,00	FXO GBPUSD C 1.242 GOLDDEFAXXX 06/09/2023	GBP	-	50.892,48	23.728,48
800.000,00	FXO EURSEK P 11.4 CRLYGB2LXXX 17/08/2023	EUR	-	854,66	-3.065,34
1.200.000,00	FXO USDSGD C 1.34 GOLDDEFAXXX 09/11/2023	USD	-	14.353,97	6.231,66
800.000,00	FXO USDBRL C 4.95 GOLDDEFAXXX 28/08/2023	USD	-	11.039,87	-2.295,30
1.800.000,00	FXO EURGBP C 0.909 GOLDDEFAXXX 11/08/2023	EUR	-	306,58	-2.942,42
800.000,00	FXO EURSEK P 11.2 SBILDEFFQFX 17/08/2023	EUR	-	276,49	-247,51
3.500.000,00	FXO EURUSD P 1 CRLYGB2LXXX 07/07/2023	EUR	-	0,04	-17.426,46
1.800.000,00	FXO USDTRY C 33 BOFAFRP3FIC 15/09/2023	USD	-	26.708,90	-27.107,73
3.000.000,00	FXO EURUSD C 1.09 GOLDDEFAXXX 27/07/2023	EUR	-	25.201,77	5.107,77
4.200.000,00	FXO EURUSD P 1.0575 BOFAFRP3FIC 07/07/2023	EUR	-	41,58	-13.902,42
1.200.000,00	FXO EURUSD P 1.0875 SOGEFRPPHCM 08/08/2023	EUR	-	7.874,21	-20.220,19
1.200.000,00	FXO USDMXN C 18.5 BOFAFRP3FIC 17/07/2023	USD	-	120,23	-22.470,46
500.000,00	FXO GBPSEK P 13.5 MSSEDEFBFXO 18/08/2023	GBP	-	3.102,55	-1.161,47
600.000,00	FXO USDTWD P 30.5 MSSEDEFBFXO 15/04/2024	USD	-	17.076,14	-14.456,24
1.000.000,00	FXO EURNOK P 11.5 SBILDEFFQFX 20/07/2023	EUR	-	3.671,34	-6.193,66
1.100.000,00	FXO USDCAD C 1.3555 CRLYGB2LXXX 07/07/2023	USD	-	26,37	-3.045,31
2.400.000,00	FXO NZDUSD P 0.6 SBILDEFFQFX 06/07/2023	NZD	-	368,06	-1.043,30
700.000,00	FXO USDCNH P 6.85 BOFAFRP3FIC 06/09/2023	USD	-	209,81	-150,40
900.000,00	FXO GBPJPY P 160 MSSEDEFBFXO 06/10/2023	GBP	-	2.151,71	-6.353,22
3.600.000,00	FXO EURUSD P 1.05 CRLYGB2LXXX 20/07/2023	EUR	-	400,03	-32.179,97
1.600.000,00	FXO AUDCHF C 0.618 UBSWDE24XXX 06/09/2023	AUD	-	2.033,85	-5.198,13
11.000.000,00	FXO MXNJPY C 6.6 MSSEDEFBFXO 11/04/2024	MXN	-	83.105,13	57.012,97
1.200.000,00	FXO USDSGD C 1.37 GOLDDEFAXXX 11/08/2023	USD	-	1.888,08	922,48
700.000,00	FXO USDNOK P 10.8 CRLYGB2LXXX 06/07/2023	USD	-	7.699,13	3.390,63
2.100.000,00	FXO EURHUF P 410 UBSWDE24XXX 18/04/2024	EUR	-	103.936,54	10.788,94
400.000,00	FXO USDCAD C 1.3785 GOLDDEFAXXX 23/08/2023	USD	-	224,25	-1.686,96
1.800.000,00	FXO EURGBP P 0.84 GOLDDEFAXXX	EUR	-	2.126,09	-244,51

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su valute</b>					
2.100.000,00	11/08/2023 FXO EURUSD C 1.1325 MSSEDEFBFXO	EUR	-	2,73	-1.719,27
800.000,00	07/07/2023 FXO EURMXN P 21 GOLDDEFAXXX	EUR	-	66.939,81	44.678,21
2.100.000,00	13/02/2024 FXO USDINR P 79.9 CCFRFRPPXXX	USD	-	256,29	-1.858,32
1.000.000,00	11/08/2023 FXO USDCAD C 1.34 GOLDDEFAXXX	USD	-	4.170,09	1.099,77
25/08/2023					
<b>Opzioni su indice</b>					
2,00	NDX JUL 12875 21.07.23 PUT	USD	-	806,60	-56.949,08
49,00	EURO STOXX 50 JUL 4125.0 21.07.23 PUT	EUR	-	2.401,00	-43.296,00
1,00	EURO STOXX 50 OCT 4075.0 20.10.23 PUT	EUR	-	429,00	-326,00
4,00	EURO STOXX 50 DEC 3225.0 15.12.23 PUT	EUR	-	516,00	-348,00
7,00	FTSE 100 SEP 7650.0 15.09.23 CALL	GBP	-	6.484,88	-8.824,43
1,00	SP 500 OCT 4400.0 20.10.23 CALL	USD	-	17.857,93	3.557,54
2,00	SP 500 DEC 4325.0 15.12.23 PUT	USD	-	17.492,21	-7.247,52
2,00	EURO STOXX 50 DEC 4500.0 15.12.23 CALL	EUR	-	2.714,00	600,00
3,00	SP 500 AUG 4275.0 18.08.23 PUT	USD	-	6.448,21	-5.046,00
36,00	FTSE 100 JUL 7575.0 21.07.23 PUT	GBP	-	31.672,78	-17.483,60
28,00	CAC 40 INDEX JUL 6900.0 21.07.23 PUT	EUR	-	1.878,80	-25.113,20
31,00	SP P/ASX 200 SEP 7350.0 21.09.23 CALL	AUD	-	13.580,23	-763,85
1,00	SP 500 DEC 4500.0 15.12.23 CALL	USD	-	16.552,70	965,65
14,00	EURO STOXX 50 OCT 4350.0 20.10.23 PUT	EUR	-	13.258,00	-8.084,00
33,00	SP P/ASX 200 JUL 7600.0 20.07.23 CALL	AUD	-	322,15	-487,67
118,00	CBOE VOLATILY JUL 17.000 19.07.23 PUT	USD	-	26.823,10	23.914,97
79,00	CBOE VOLATILY AUG 15.000 16.08.23 PUT	USD	-	6.516,96	59,69
15,00	FTSE MIB SEP 27000 15.09.23 PUT	EUR	-	13.125,00	-26.625,00
6,00	SP 500 JUL 4000.0 21.07.23 PUT	USD	-	1.248,40	-38.270,39
16,00	NIKKEI 225 JUL 29750 14.07.23 CALL	JPY	-	350.059,01	304.816,68
30,00	EURO STOXX 50 JUL 4475.0 21.07.23 CALL	EUR	-	4.770,00	-11.580,00
2,00	NDX SEP 12750 15.09.23 PUT	USD	-	9.459,21	-61.586,58
1,00	EURO STOXX 50 OCT 5600.0 20.10.23 CALL	EUR	-	1,00	-1,00
12,00	FTSE 100 SEP 7775.0 15.09.23 PUT	GBP	-	37.545,88	7.985,88
8,00	FTSE 100 SEP 7675.0 15.09.23 CALL	GBP	-	6.432,44	1.124,87
50,00	OMX AUG 2210.0 18.08.23 PUT	SEK	-	7.319,09	-2.686,30
6,00	SMI SEP 12000 15.09.23 CALL	CHF	-	688,49	-8.190,35
7,00	FTSE MIB DEC 28000 15.12.23 PUT	EUR	-	18.480,00	-4.432,50
11,00	EURO STOXX 50 NOV 4400.0 17.11.23 PUT	EUR	-	13.893,00	-3.083,00
3,00	EURO STOXX 50 DEC 3875.0 15.12.23 PUT	EUR	-	1.299,00	-870,00
6,00	RUSSELL 2000 JUL 1845.0 21.07.23 CALL	USD	-	32.964,25	19.569,27
3,00	EURO STOXX 50 DEC 3425.0 15.12.23 PUT	EUR	-	540,00	-384,00
8,00	SMI SEP 11050 15.09.23 PUT	CHF	-	8.835,61	-2.999,78
5,00	NIKKEI 225 JUL 26750 14.07.23 PUT	JPY	-	95,12	-16.466,71
6,00	RUSSELL 2000 JUL 1935.0 21.07.23 CALL	USD	-	7.160,40	4.105,90
3,00	EURO STOXX 50 NOV 3900.0 17.11.23 PUT	EUR	-	1.092,00	-848,00
14,00	EURO STOXX 50 OCT 4350.0 20.10.23 CALL	EUR	-	25.564,00	2.268,00
10,00	FTSE 100 SEP 7800.0 15.09.23 PUT	GBP	-	33.560,57	8.874,09
1,00	EURO STOXX 50 OCT 4725.0 20.10.23 CALL	EUR	-	189,00	42,00
62,00	EURO STOXX 50 DEC 3000.0 20.12.24 PUT	EUR	-	31.558,00	-70.122,00
7,00	FTSE MIB DEC 28000 15.12.23 CALL	EUR	-	25.130,00	4.305,00
19,00	FTSE 100 DEC 8800.0 15.12.23 CALL	GBP	-	442,81	-18.133,82
19,00	FTSE 100 DEC 8600.0 15.12.23 CALL	GBP	-	885,63	-26.763,30
9,00	NIKKEI 225 SEP 25000 08.09.23 PUT	JPY	-	1.255,65	-11.542,44

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su indice</b>					
10,00	FTSE 100 SEP 8100.0 15.09.23 CALL	GBP	-	582,65	-17.889,84
1,00	EURO STOXX 50 DEC 5150.0 15.12.23 CALL	EUR	-	34,00	-
2,00	EURO STOXX 50 NOV 5600.0 17.11.23 CALL	EUR	-	2,00	-8,00
3,00	SP 500 JUL 4295.0 21.07.23 CALL	USD	-	46.333,64	30.747,02
2,00	EURO STOXX 50 OCT 3000.0 20.10.23 PUT	EUR	-	90,00	-86,00
13,00	SMI SEP 11100 15.09.23 PUT	CHF	-	15.902,87	-12.958,34
14,00	EURO STOXX 50 OCT 4375.0 20.10.23 PUT	EUR	-	14.322,00	-5.420,00
47,00	SP P/ASX 200 JUL 7075.0 20.07.23 PUT	AUD	-	7.914,58	-21.227,48
1,00	EURO STOXX 50 DEC 5600.0 15.12.23 CALL	EUR	-	3,00	-4,00
2,00	EURO STOXX 50 DEC 4075.0 15.12.23 PUT	EUR	-	1.332,00	-820,00
192,00	CBOE VOLATILY JUL 25.000 19.07.23 CALL	USD	-	2.463,79	-26.253,01
15,00	DJ INDU DEC 350.00 15.12.23 PUT	USD	-	15.329,97	-3.822,48
15,00	DJ INDU DEC 350.00 15.12.23 CALL	USD	-	14.848,76	-396,15
2,00	EURO STOXX 50 NOV 5175.0 17.11.23 CALL	EUR	-	34,00	-5,00
7,00	SP 500 SEP 4150.0 15.09.23 PUT	USD	-	17.965,17	-29.052,52
4,00	NIKKEI 225 JUL 29000 14.07.23 PUT	JPY	-	126,83	-11.110,50
6,00	EURO STOXX 50 NOV 3025.0 17.11.23 PUT	EUR	-	420,00	-380,00
7,00	FTSE 100 SEP 7600.0 15.09.23 PUT	GBP	-	13.092,12	659,21
14,00	EURO STOXX 50 OCT 4375.0 20.10.23 CALL	EUR	-	23.156,00	2.886,00
14,00	FTSE 100 DEC 6600.0 15.12.23 PUT	GBP	-	7.586,09	-26.013,26
7,00	TOPIX SEC 1 JUL 2175.0 14.07.23 CALL	JPY	-	51.938,10	32.332,32
2,00	EURO STOXX 50 DEC 4725.0 15.12.23 CALL	EUR	-	900,00	192,00
135,00	EURO STOXX 50 JUL 4575.0 21.07.23 CALL	EUR	-	3.375,00	1.391,00
11,00	EURO STOXX 50 NOV 4400.0 17.11.23 CALL	EUR	-	19.140,00	1.185,00
7,00	TOPIX SEC 1 AUG 2200.0 10.08.23 CALL	JPY	-	47.720,91	29.392,55
1,00	EURO STOXX 50 OCT 4500.0 20.10.23 CALL	EUR	-	913,00	253,00
8,00	TOPIX SEC 1 JUL 2100.0 14.07.23 CALL	JPY	-	96.393,06	80.147,05
11,00	FTSE 100 DEC 7450.0 15.12.23 PUT	GBP	-	21.342,42	-6.504,87
1,00	SP 500 DEC 4500.0 15.12.23 PUT	USD	-	12.859,76	-3.391,39
7,00	FTSE 100 SEP 7650.0 15.09.23 PUT	GBP	-	15.253,74	992,85
5,00	NIKKEI 225 AUG 31500 10.08.23 CALL	JPY	-	61.196,91	40.842,46
7,00	NIKKEI 225 JUL 26500 14.07.23 PUT	JPY	-	133,17	-19.845,78
18,00	SMI JUL 11150 21.07.23 PUT	CHF	-	7.911,48	-16.604,65
7,00	SP 500 SEP 4090.0 15.09.23 PUT	USD	-	14.917,51	-22.477,37
7,00	NIKKEI 225 JUL 29500 14.07.23 CALL	JPY	-	164.248,70	146.869,78
3,00	EURO STOXX 50 OCT 2575.0 20.10.23 PUT	EUR	-	63,00	-69,00
3,00	SP 500 SEP 4130.0 15.09.23 PUT	USD	-	7.039,41	-10.994,10
6,00	FTSE MIB SEP 28500 15.09.23 CALL	EUR	-	9.900,00	780,00
3,00	SP 500 SEP 4140.0 15.09.23 PUT	USD	-	7.190,65	-11.359,09
3,00	SP 500 DEC 3575.0 15.12.23 PUT	USD	-	6.296,98	-50.023,13
5,00	SP 500 AUG 4225.0 31.08.23 PUT	USD	-	12.786,43	-10.015,17
12,00	FTSE 100 SEP 8050.0 15.09.23 CALL	GBP	-	908,93	-25.593,14
2,00	EURO STOXX 50 NOV 4750.0 17.11.23 CALL	EUR	-	538,00	-46,00
14,00	FTSE 100 DEC 6975.0 15.12.23 PUT	GBP	-	12.643,48	-33.181,18
15,00	FTSE MIB SEP 28000 15.09.23 CALL	EUR	-	35.850,00	-3.900,00
11,00	NIKKEI 225 JUL 27750 14.07.23 PUT	JPY	-	279,03	-27.188,35
100,00	CBOE VOLATILY NOV 20.000 15.11.23 PUT	USD	-	33.913,84	18.146,09
1,00	EURO STOXX 50 OCT 3850.0 20.10.23 PUT	EUR	-	240,00	-206,00
1,00	SP 500 OCT 4350.0 20.10.23 CALL	USD	-	20.242,90	6.199,12
1,00	SP 500 OCT 4350.0 20.10.23 PUT	USD	-	6.592,12	-7.408,72
1,00	SP 500 OCT 4400.0 20.10.23 PUT	USD	-	7.615,03	-4.189,64
9,00	NIKKEI 225 SEP 31875 08.09.23 PUT	JPY	-	29.678,92	-3.808,80
18,00	SMI JUL 11700 21.07.23 CALL	CHF	-	590,13	-469,89

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su indice</b>					
4,00	EURO STOXX 50 NOV 3450.0 17.11.23 PUT	EUR	-	576,00	-488,00
6,00	FTSE MIB SEP 26500 15.09.23 PUT	EUR	-	3.975,00	-11.325,00
1,00	EURO STOXX 50 OCT 5800.0 20.10.23 CALL	EUR	-	1,00	-1,00
2,00	EURO STOXX 50 OCT 3425.0 20.10.23 PUT	EUR	-	194,00	-174,00
7,00	FTSE 100 SEP 7600.0 15.09.23 CALL	GBP	-	8.401,79	-6.102,30
50,00	OMX SEP 2240.0 15.09.23 PUT	SEK	-	14.744,26	-5.987,13
6,00	SMI SEP 11300 15.09.23 PUT	CHF	-	11.206,39	-2.081,04
17,00	FTSE 100 SEP 7450.0 15.09.23 PUT	GBP	-	20.503,41	-9.015,91
1,00	EURO STOXX 50 OCT 5150.0 20.10.23 CALL	EUR	-	10,00	-1,00
14,00	FTSE 100 DEC 6200.0 15.12.23 PUT	GBP	-	4.649,54	-19.639,15
<b>Opzioni su tassi di interesse</b>					
7.000.000,00	IEUROP395M OTC SEP 1.000 20.09.23 PUT	EUR	-	5.548,34	-7.079,66
4.100.000,00	EURIBOR3M OTC AUG 3.792 25.08.23 CALL	EUR	-	1.496,21	-4.653,79
3.600.000,00	EURIBOR6M OTC JAN 2.100 21.01.25 CALL	EUR	-	25.160,15	-17.319,85
5.600.000,00	USD_SOFR OTC JUL 3.750 24.07.23 PUT	USD	-	104.475,52	73.868,19
12.000.000,00	IEUROP395M OTC SEP 0.825 20.09.23 PUT	EUR	-	22.744,08	-22.255,92
10.300.000,00	IEUROP395M OTC JUL 1.000 19.07.23 PUT	EUR	-	362,56	-30.537,44
6.000.000,00	IXOVER395M OTC SEP 5.000 20.09.23 PUT	EUR	-	27.760,08	-27.271,92
15.000.000,00	XNAIG4015 OTC JUL 0.825 19.07.23 PUT	USD	-	502,38	-46.862,92
4.100.000,00	EURIBOR3M OTC AUG 3.792 25.08.23 PUT	EUR	-	10.932,32	4.372,32
6.000.000,00	IXOVER395M OTC JUL 4.500 19.07.23 PUT	EUR	-	5.898,60	-118.541,40
<b>Opzioni su futures</b>					
18,00	US 2YEAR NOTE SEP 103.75 25.08.23 CALL	USD	-	773,39	-15.894,82
29,00	EURX EURO SCHA SEP 105.50 25.08.23 CALL	EUR	-	-10.440,00	-10.440,00
15,00	USD 5Y TREASUR SEP 110.00 25.08.23 CALL	USD	-	1.933,43	-14.250,07
28,00	US BOND FUTR SEP 123.00 25.08.23 PUT	USD	-	20.852,43	-9.445,32
42,00	USD 10Y TREASU SEP 112.00 25.08.23 PUT	USD	-	41.504,35	8.092,68
20,00	USD 10Y TREASU AUG 115.00 21.07.23 CALL	USD	-	1.432,17	-13.373,61
8,00	USD 10Y TREASU SEP 115.50 25.08.23 CALL	USD	-	1.947,75	-9.048,64
45,00	IEURO BUND AUG 132.50 21.07.23 PUT	EUR	-	-25.400,00	-25.400,00
30,00	IEURO BUND SEP 130.50 25.08.23 PUT	EUR	-	-7.200,00	-7.200,00
30,00	IEURO BUND SEP 131.00 25.08.23 PUT	EUR	-	-1.800,00	-1.800,00
40,00	IEURO BUND AUG 134.00 21.07.23 CALL	EUR	-	-32.800,00	-32.800,00
27,00	US 2YEAR NOTE SEP 104.50 25.08.23 CALL	USD	-	386,71	-27.418,24
121,00	VSTOXX INDEX AUG 22.000 16.08.23 CALL	EUR	-	10.285,00	-6.655,00
100,00	USD 5Y TREASUR SEP 108.00 25.08.23 CALL	USD	-	47.977,82	-27.000,41
40,00	IEURO BUND SEP 133.50 25.08.23 CALL	EUR	-	10.710,00	10.710,00
44,00	IEURO BUND SEP 132.50 25.08.23 PUT	EUR	-	-8.190,00	-8.190,00
51,00	EURX EURO BOBL SEP 115.50 25.08.23 PUT	EUR	-	8.415,00	8.415,00
27,00	US 2YEAR NOTE SEP 104.00 25.08.23 CALL	USD	-	1.160,08	-21.560,33
42,00	USD 10Y TREASU SEP 111.00 25.08.23 PUT	USD	-	27.068,06	3.591,86
100,00	USD 5Y TREASUR AUG 108.50 21.07.23 CALL	USD	-	10.025,21	-77.563,64
30,00	IEURO BUND SEP 133.00 25.08.23 CALL	EUR	-	12.900,00	12.900,00
22,00	IEURO BUND SEP 132.00 25.08.23 PUT	EUR	-	-5.940,00	-5.940,00
				<b>2.621.847,31</b>	<b>-825.454,21</b>

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni emesse</b>					
<b>Opzioni su valute</b>					
1.200.000,00	FXO USDSGD C 1.37 UBSWDE24XXX 11/08/2023	USD	215.851,57	-1.888,08	1.058,05
600.000,00	FXO EURGBP P 0.855 GOLDDEFAXXX 11/08/2023	EUR	235.357,13	-3.273,47	-1.020,47
2.100.000,00	FXO EURHUF P 380 UBSWDE24XXX 18/04/2024	EUR	523.255,40	-24.347,59	5.976,41
4.200.000,00	FXO EURUSD P 1.09 BOFAFRP3FIC 07/07/2023	EUR	1.889.340,85	-13.187,62	71.904,38
2.000.000,00	FXO USDHKD C 7.85 MSSEDEFBFXO 28/03/2024	USD	336.581,08	-1.791,55	1.690,54
2.100.000,00	FXO EURUSD C 1.1325 SBILDEFFQFX 07/07/2023	EUR	933,30	-2,73	6.468,84
700.000,00	FXO USDNOK P 10.6 CRLYGB2LXXX 06/07/2023	USD	172.482,36	-1.786,39	-70,85
3.000.000,00	FXO EURUSD C 1.11 GOLDDEFAXXX 27/07/2023	EUR	552.299,70	-5.387,64	1.761,36
1.200.000,00	FXO EURJPY C 139 SOGEFRPPHCM 08/08/2023	EUR	1.056.669,79	-137.742,30	-104.190,30
2.100.000,00	FXO USDJPY C 145 CCFRFRPPXXX 28/08/2023	USD	735.867,79	-21.926,73	-12.483,55
600.000,00	FXO EURGBP C 0.889 GOLDDEFAXXX 11/08/2023	EUR	47.483,76	-511,39	2.477,81
600.000,00	FXO USDSGD P 1.3 GOLDDEFAXXX 09/11/2023	USD	55.677,46	-742,67	3.116,42
400.000,00	FXO USDCAD C 1.4078 GOLDDEFAXXX 23/05/2024	USD	58.072,88	-2.156,48	2.064,89
900.000,00	FXO USDTWD P 29.5 MSSEDEFBFXO 15/04/2024	USD	293.241,27	-11.856,49	16.132,92
1.200.000,00	FXO USDSGD C 1.38 GOLDDEFAXXX 09/11/2023	USD	219.722,97	-3.640,11	-842,43
600.000,00	FXO USDTRY C 25.5 BOFAFRP3FIC 15/09/2023	USD	350.243,82	-41.554,25	-7.685,98
2.400.000,00	FXO NZDUSD P 0.6 UBSWDE24XXX 06/07/2023	NZD	68.858,22	-368,06	8.101,57
900.000,00	FXO GBPJPY C 180 MSSEDEFBFXO 06/10/2023	GBP	538.573,90	-27.834,91	-21.723,96
500.000,00	FXO GBPSEK C 13.8 MSSEDEFBFXO 20/07/2023	GBP	219.702,20	-2.830,79	644,68
800.000,00	FXO EURSEK P 11.2 CRLYGB2LXXX 17/08/2023	EUR	25.592,69	-276,49	963,51
1.200.000,00	FXO USDMXN C 19 BOFAFRP3FIC 17/07/2023	USD	1.192,67	-10,79	14.060,30
1.200.000,00	FXO USDMXN P 17.5 BOFAFRP3FIC 17/07/2023	USD	885.530,77	-22.522,71	-17.465,91
1.100.000,00	FXO USDCAD C 1.3978 CRLYGB2LXXX 07/06/2024	USD	184.067,48	-7.156,89	4.338,79
800.000,00	FXO EURBRL C 5.5 CRLYGB2LXXX 29/08/2023	EUR	800.000,00	-8.407,62	1.672,38
700.000,00	FXO USDNOK C 11.35 CRLYGB2LXXX 06/07/2023	USD	5.714,18	-46,57	3.436,90
500.000,00	FXO GBPSEK P 13.15 MSSEDEFBFXO 18/08/2023	GBP	45.212,98	-596,45	367,34
700.000,00	FXO USDCNH P 6.85 SOGEFRPPHCM 06/09/2023	USD	18.754,35	-209,81	913,15
700.000,00	FXO USDJPY C 150 GOLDDEFAXXX 01/08/2023	USD	641.613,20	-907,62	-73,16
11.000.000,00	FXO MXNJPY C 7 MSSEDEFBFXO 11/04/2024	MXN	354.489,24	-61.076,94	-47.897,21

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su valute</b>					
700.000,00	FXO USDCNH C 7.25 SOGEFRPPHCM 06/09/2023	USD	294.025,66	-5.934,28	-3.294,18
700.000,00	FXO USDINR C 83.9 CCFRFRPPXXX 11/08/2023	USD	54.842,20	-388,46	2.016,69
1.000.000,00	FXO USDCAD P 1.3 GOLDDEFAXXX 27/07/2023	USD	129.393,92	-1.088,78	1.301,17
800.000,00	FXO EURSEK C 11.7 CRLYGB2LXXX 18/07/2023	EUR	535.779,90	-8.348,65	-4.268,65
3.000.000,00	FXO EURUSD C 1.09 SBILDEFFQFX 27/07/2023	EUR	1.622.079,33	-25.201,77	9.928,23
800.000,00	FXO EURMXN P 20 GOLDDEFAXXX 13/02/2024	EUR	482.845,28	-37.287,53	-26.785,93
1.200.000,00	FXO NZDUSD C 0.64 UBSWDE24XXX 07/08/2023	NZD	51.306,95	-707,80	459,49
700.000,00	FXO USDINR P 81.2 CCFRFRPPXXX 11/08/2023	USD	107.369,78	-692,20	1.473,90
1.200.000,00	FXO USDSGD C 1.34 GOLDDEFAXXX 11/08/2023	USD	780.527,96	-12.309,42	-1.454,92
800.000,00	FXO USDBRL P 4.7 GOLDDEFAXXX 27/07/2023	USD	733.272,23	-2.480,36	-658,25
<b>Opzioni su indice</b>					
7,00	NIKKEI 225 AUG 32250 10.08.23 CALL	JPY	994.486,02	-59.928,58	-41.865,82
11,00	TOPIX SEC 1 JUL 2225.0 14.07.23 CALL	JPY	1.207.548,21	-50.225,86	-32.414,88
62,00	EURO STOXX 50 DEC 3000.0 15.12.23 PUT	EUR	65.458,46	-5.518,00	49.042,00
2,00	NDX JUL 14125 21.07.23 CALL	USD	2.718.622,94	-201.659,03	-177.159,92
7,00	ESTX50 JUL 4200.0 14.07.23 PUT	EUR	18.784,11	-252,00	421,00
15,00	FTSE MIB SEP 25500 15.09.23 PUT	EUR	122.804,11	-5.812,50	19.462,50
8,00	SMI DEC 11100 15.12.23 PUT	CHF	341.165,06	-18.999,03	5.831,51
14,00	FTSE 100 DEC 8400.0 15.12.23 CALL	GBP	62.664,01	-1.549,85	26.382,14
5,00	ESTX50 JUL 4250.0 07.07.23 PUT	EUR	7.918,36	-60,00	464,00
40,00	SP P/ASX 200 SEP 6850.0 21.09.23 PUT	AUD	351.594,83	-16.278,22	13.215,79
100,00	CBOE VOLATILY NOV 16.000 15.11.23 PUT	USD	30.767,46	-10.815,77	-8.033,23
30,00	EURO STOXX 50 JUL 4250.0 21.07.23 PUT	EUR	186.081,51	-3.270,00	13.710,00
7,00	SP 500 SEP 3800.0 15.09.23 PUT	USD	145.626,55	-6.409,72	11.145,12
15,00	FTSE MIB SEP 29000 15.09.23 CALL	EUR	388.526,80	-15.637,50	6.862,50
50,00	OMX AUG 2420.0 18.08.23 CALL	SEK	168.573,94	-3.733,80	3.360,54
7,00	ESTX50 JUL 4150.0 14.07.23 PUT	EUR	12.933,32	-182,00	716,00
2,00	ESTX50 JUL 4450.0 07.07.23 CALL	EUR	18.036,27	-132,00	56,00
35,00	MSCI EM (EUREX DEC 1080.0 18.12.23 CALL	USD	355.521,76	-15.559,12	90.074,36
3,00	SP 500 AUG 3850.0 18.08.23 PUT	USD	41.607,59	-1.369,39	1.602,56
1,00	SP 500 JUL 4300.0 06.07.23 PUT	USD	12.645,44	-61,41	319,73
50,00	OMX SEP 2400.0 15.09.23 CALL	SEK	293.044,23	-10.395,23	4.425,78
5,00	SP 500 AUG 3750.0 31.08.23 PUT	USD	71.385,56	-2.786,43	3.109,74
6,00	FTSE MIB SEP 29500 15.09.23 CALL	EUR	107.559,46	-3.585,00	915,00
5,00	NIKKEI 225 DEC 32500 08.12.23 PUT	JPY	451.465,08	-42.806,13	10.189,13
6,00	SMI SEP 10600 15.09.23 PUT	CHF	90.838,67	-2.827,72	3.319,64
9,00	ESTX50 JUL 4500.0 14.07.23 CALL	EUR	48.697,93	-450,00	-238,00
45,00	ESTX50 JUL 4050.0 21.07.23 PUT	EUR	77.204,03	-1.530,00	4.050,00
14,00	FTSE 100 DEC 4800.0 15.12.23 PUT	GBP	12.287,06	-978,85	6.550,64
1,00	SP 500 JUL 4290.0 05.07.23 PUT	USD	8.158,35	-38,50	300,93
3,00	SP 500 DEC 3400.0 15.12.23 PUT	USD	57.516,37	-4.674,61	40.282,41
62,00	EURO STOXX 50 DEC 2000.0 20.12.24 PUT	EUR	49.093,84	-8.804,00	22.453,00
12,00	FTSE 100 SEP 7400.0 15.09.23 PUT	GBP	359.133,26	-12.585,21	4.811,02
35,00	MSCI EM (EUREX DEC 1120.0 18.12.23 CALL	USD	166.650,82	-5.934,92	75.641,72

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su indice</b>					
CALL					
7,00	ESTX50 JUL 4225.0 07.07.23 PUT	EUR	9.238,09	-77,00	679,00
18,00	SMI JUL 10600 21.07.23 PUT	CHF	83.210,99	-1.235,59	10.168,41
7,00	SP 500 SEP 3950.0 15.09.23 PUT	USD	228.433,80	-9.624,20	18.479,24
6,00	FTSE MIB SEP 24000 15.09.23 PUT	EUR	24.560,82	-1.110,00	6.090,00
36,00	FTSE 100 JUL 7225.0 21.07.23 PUT	GBP	236.964,76	-3.356,06	23.141,51
9,00	ESTX50 JUL 4225.0 14.07.23 PUT	EUR	30.485,69	-405,00	460,00
5,00	ESTX50 JUL 4275.0 07.07.23 PUT	EUR	11.877,54	-90,00	600,00
8,00	TOPIX SEC 1 JUL 2200.0 14.07.23 CALL	JPY	943.129,99	-47.435,53	-42.715,22
10,00	FTSE 100 SEP 7300.0 15.09.23 PUT	GBP	231.698,88	-7.924,02	4.729,92
5,00	ESTX50 JUL 4475.0 07.07.23 CALL	EUR	23.315,18	-150,00	100,00
17,00	EURO STOXX 50 DEC 4800.0 19.12.25 CALL	EUR	319.329,94	-52.734,00	-21.161,00
3,00	SP 500 SEP 3885.0 15.09.23 PUT	USD	80.767,66	-3.437,21	5.896,62
3,00	SP 500 SEP 3925.0 15.09.23 PUT	USD	90.557,69	-3.904,67	6.442,11
1,00	SP 500 JUL 4240.0 03.07.23 PUT	USD	4.079,18	-27,50	200,81
3,00	SP 500 DEC 4850.0 15.12.23 CALL	USD	227.617,97	-9.263,98	14.015,78
47,00	SP P/ASX 200 JUL 6775.0 20.07.23 PUT	AUD	64.034,21	-1.605,86	14.232,01
5,00	ESTX50 JUL 4175.0 07.07.23 PUT	EUR	5.058,95	-50,00	397,00
1,00	SP 500 JUL 4510.0 06.07.23 CALL	USD	34.265,07	-151,24	-109,91
12,00	RUSSELL 2000 JUL 1890.0 21.07.23 CALL	USD	1.080.989,92	-32.249,31	-19.078,51
16,00	NIKKEI 225 JUL 30750 14.07.23 CALL	JPY	2.896.111,67	-249.607,29	-232.164,46
11,00	TOPIX SEC 1 AUG 2250.0 10.08.23 CALL	JPY	973.125,99	-49.877,07	-32.009,27
5,00	SP 500 AUG 4585.0 31.08.23 CALL	USD	599.638,74	-16.709,44	-2.337,52
3,00	NIKKEI 225 SEP 27250 08.09.23 PUT	JPY	22.099,69	-1.027,35	9.402,99
2,00	NDX SEP 11750 15.09.23 PUT	USD	80.696,08	-4.482,13	32.616,95
9,00	NIKKEI 225 SEP 34875 08.09.23 CALL	JPY	517.132,73	-22.259,19	20.505,77
193,00	CBOE VOLATILY OCT 25.000 18.10.23 CALL	USD	79.816,02	-26.712,19	29.875,90
3,00	SP 500 DEC 3725.0 15.12.23 PUT	USD	107.690,22	-8.001,83	59.593,95
100,00	CBOE VOLATILY SEP 20.000 20.09.23 PUT	USD	68.136,85	-38.405,13	-25.141,67
46,00	MSCI EM (EUREX SEP 960.00 18.09.23 PUT	USD	602.845,19	-31.622,36	35.179,50
79,00	CBOE VOLATILY OCT 16.000 18.10.23 PUT	USD	27.356,88	-9.123,74	-199,65
3,00	SP 500 DEC 2700.0 15.12.23 PUT	USD	17.132,54	-1.627,86	15.008,86
11,00	SP P/ASX 200 JUL 6875.0 20.07.23 PUT	AUD	23.688,70	-563,76	988,39
3,00	SP 500 AUG 4600.0 18.08.23 CALL	USD	268.001,81	-5.650,78	2.592,32
50,00	OMX AUG 2030.0 18.08.23 PUT	SEK	44.103,65	-1.527,46	1.017,01
<b>Opzioni su tassi di interesse</b>					
5.600.000,00	USD_SOFR OTC JUL 4.100 24.07.23 PUT	USD	4.807.926,35	-66.142,31	-48.317,84
7.000.000,00	IEUROP395M OTC SEP 1.200 20.09.23 PUT	EUR	690.389,00	-2.887,99	3.762,01
5.600.000,00	USD_SOFR OTC JUL 4.350 26.07.23 PUT	USD	4.327.751,40	-44.040,95	-33.922,59
8.000.000,00	IXOVER395M OTC SEP 6.00 20.09.23 PUT	EUR	943.656,00	-16.924,72	18.275,28
18.000.000,00	IEUROP395M OTC SEP 1.100 20.09.23 PUT	EUR	2.417.814,00	-10.038,96	13.901,04
4.000.000,00	USD_SOFR OTC JAN 2.550 21.01.25 CALL	USD	1.153.973,97	-29.386,29	33.860,39
<b>Opzioni su futures</b>					
30,00	IEURO BUND SEP 127.50 25.08.23 PUT	EUR	365.110,20	2.550,00	2.550,00
3,00	IEURO BUND AUG 136.00 21.07.23 CALL	EUR	85.861,08	-120,00	-120,00
4,00	EURX EURO SCHA AUG 104.50 21.07.23 PUT	EUR	100.236,60	-20,00	-20,00
5,00	USD 10Y TREASU AUG 110.00 21.07.23 PUT	USD	56.504,81	-429,65	71,98
77,00	EURX EURO BOBL SEP 114.00 25.08.23 PUT	EUR	2.058.133,77	-2.310,00	-2.310,00
4,00	IEURO BUND AUG 132.00 21.07.23 PUT	EUR	134.809,92	-480,00	-480,00
5,00	USD 10Y TREASU AUG 116.00 21.07.23 CALL	USD	19.006,16	-143,22	501,73
18,00	US 2YEAR NOTE SEP 102.75 25.08.23 PUT	USD	2.741.989,50	-38.668,65	-26.167,49

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Nonrealizzato (in EUR)
<b>Opzioni su futures</b>					
8,00	USD 10Y TREASU SEP 113.00 25.08.23 PUT	USD	481.626,47	-11.801,10	-3.351,24
59,00	IEURO BUND SEP 130.00 25.08.23 PUT	EUR	1.586.022,66	9.420,00	9.420,00
200,00	USD 5Y TREASUR SEP 109.75 25.08.23 CALL	USD	2.688.012,83	-30.075,71	29.157,95
121,00	VSTOXX INDEX AUG 15.000 16.08.23 PUT	EUR	54.360,30	-11.192,50	-6.352,50
42,00	USD 10Y TREASU SEP 109.00 25.08.23 PUT	USD	677.441,33	-10.225,71	-895,43
29,00	EURX EURO SCHA SEP 104.80 25.08.23 PUT	EUR	1.438.227,45	-1.015,00	-1.015,00
30,00	IEURO BUND SEP 128.00 25.08.23 PUT	EUR	425.293,20	1.800,00	1.800,00
121,00	VSTOXX INDEX AUG 27.000 16.08.23 CALL	EUR	27.674,34	-6.352,50	3.327,50
4,00	EURX EURO SCHA AUG 105.60 21.07.23 CALL	EUR	39.423,60	80,00	80,00
37,00	US BOND FUTR SEP 119.00 25.08.23 PUT	USD	385.468,10	-9.008,36	7.129,11
15,00	USD 5Y TREASUR SEP 112.00 25.08.23 CALL	USD	60.333,13	-644,48	7.682,39
15,00	USD 5Y TREASUR SEP 108.00 25.08.23 PUT	USD	949.143,22	-19.549,15	-9.862,20
18,00	US 2YEAR NOTE SEP 105.00 25.08.23 CALL	USD	46.757,43	-257,81	6.513,65
8,00	USD 10Y TREASU SEP 118.00 25.08.23 CALL	USD	50.135,18	-687,44	5.100,13
42,00	USD 10Y TREASU SEP 110.00 25.08.23 PUT	USD	904.143,47	-16.842,35	-925,77
6,00	USD 10Y TREASU AUG 111.00 21.07.23 PUT	USD	145.474,21	-1.374,89	-600,84
60,00	IEURO BUND SEP 135.50 25.08.23 CALL	EUR	2.880.759,60	-14.400,00	-14.400,00
6,00	USD 10Y TREASU AUG 110.50 21.07.23 PUT	USD	99.859,41	-859,30	-174,68
15,00	IEURO BUND SEP 139.00 25.08.23 CALL	EUR	290.884,50	-980,00	-980,00
22,00	IEURO BUND SEP 129.50 25.08.23 PUT	EUR	509.014,44	4.540,00	4.540,00
45,00	IEURO BUND AUG 131.00 21.07.23 PUT	EUR	932.836,50	11.700,00	11.700,00
15,00	IEURO BUND SEP 139.50 25.08.23 CALL	EUR	248.756,40	3.300,00	3.300,00
27,00	US 2YEAR NOTE SEP 103.5 PUT	USD	4.743.734,19	-92.031,39	-68.958,90
29,00	EURX EURO SCHA SEP 106.30 25.08.23 CALL	EUR	234.130,05	5.655,00	5.655,00
3,00	IEURO BUND AUG 130.00 21.07.23 PUT	EUR	35.708,58	600,00	600,00
27,00	US 2YEAR NOTE SEP 103.00 25.08.23 PUT	USD	4.373.489,95	-68.830,20	-48.851,90
12,00	US 2YEAR NOTE SEP 105.25 25.08.23 CALL	USD	28.945,08	-171,87	3.658,39
80,00	IEURO BUND SEP 136.00 25.08.23 CALL	EUR	3.423.744,00	-8.620,00	-8.620,00
6,00	USD 10Y TREASU AUG 115.50 21.07.23 CALL	USD	34.519,30	-257,79	940,29
				<b>-2.132.484,81</b>	<b>-93.885,82</b>

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni acquistate</b>					
<b>Opzioni su valute</b>					
8.420.000,00	FXO EURUSD P 1.1 SOGEFRPPHCM 31/08/2023	EUR	-	114.817,90	8.641,70
<b>Opzioni su indice</b>					
38,00	SP 500 JUL 4000.0 21.07.23 PUT	USD	-	7.906,51	-508.367,57



24,00	SP 500	AUG 4180.0	18.08.23	PUT	USD	-	35.967,00	-217.065,42
35,00	SP 500	SEP 4150.0	15.09.23	PUT	USD	-	89.825,85	-70.002,89

**Commodity Markets Fund**

**Opzioni su futures**

---

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su futures</b>					
228,00	US 2YEAR NOTE SEP 102.50 25.08.23 PUT	USD	-	401.638,61	193.509,90
284,00	USD 10Y TREASU AUG 113.00 21.07.23 PUT	USD	-	296.917,97	62.735,52
24,00	NASDAQ 100 E-M SEP 14000 15.09.23 PUT	USD	-	63.794,68	-179.860,03
				<b>1.010.868,52</b>	<b>-710.408,79</b>
<b>Opzioni emesse</b>					
<b>Opzioni su azioni</b>					
52,00	ARISTA NETWORK JUL 160.00 21.07.23 PUT	USD	306.566,45	-15.252,06	12.374,08
24,00	NVIDIA CORP JUL 405.00 21.07.23 PUT	USD	266.142,01	-15.178,74	7.870,24
30,00	BIOGEN JUL 285.00 21.07.23 PUT	USD	372.837,58	-16.498,63	-545,59
221,00	KROGER AUG 45.000 18.08.23 PUT	USD	254.200,64	-11.546,29	8.396,84
70,00	TARGET CORP AUG 125.00 18.08.23 PUT	USD	269.965,81	-25.215,40	4.641,51
20,00	INTUIT INC AUG 440.00 18.08.23 PUT	USD	262.062,84	-18.148,49	7.824,13
96,00	MAC CORMICK AUG 90.000 18.08.23 PUT	USD	536.931,26	-36.076,99	-21.172,88
125,00	EDISON INTL AUG 67.500 18.08.23 PUT	USD	285.374,66	-15.467,46	3.611,60
163,00	NEWMONT MINING AUG 42.500 18.08.23 PUT	USD	285.536,55	-24.651,70	3.383,89
65,00	ALPHABET -A- JUL 120.00 21.07.23 PUT	USD	335.895,10	-15.311,64	3.828,28
344,00	BANK AMERICA JUL 29.000 21.07.23 PUT	USD	492.111,07	-25.224,56	1.762,13
93,00	WALT DISNEY JUL 95.000 21.07.23 PUT	USD	664.395,41	-50.122,82	-16.781,12
19,00	UNITEDHEALTH N AUG 470.00 18.08.23 PUT	USD	289.617,54	-15.238,31	1.853,01
87,00	CELANESE CORP- AUG 105.00 18.08.23 PUT	USD	154.901,47	-11.961,50	8.678,68
104,00	3M JUL 95.000 21.07.23 PUT	USD	125.942,76	-3.717,69	11.725,69
181,00	METLIFE JUL 52.500 21.07.23 PUT	USD	101.287,66	-3.318,06	16.546,52
118,00	ETSY INC JUL 85.000 21.07.23 PUT	USD	448.637,95	-38.395,97	324,56
208,00	BAXTER INTL JUL 42.500 21.07.23 PUT	USD	103.714,02	-2.859,76	35.915,86
37,00	NIKE INC JUL 120.00 21.07.23 PUT	USD	406.966,09	-32.998,17	13.331,14
<b>Opzioni su valute</b>					
4.210.000,00	FXO EURUSD P 1.07 MSSEDEFBFXO 31/08/2023	EUR	923.346,13	-15.353,70	18.789,40
<b>Opzioni su indice</b>					
25,00	RUSSELL 2000 SEP 1760.0 15.09.23 PUT	USD	758.203,48	-42.048,58	144.943,41
18,00	SP 500 JUL 4150.0 21.07.23 CALL	USD	6.975.389,37	-517.099,91	-336.396,49
20,00	SP 500 JUL 4200.0 21.07.23 CALL	USD	7.179.348,12	-498.808,43	-332.595,13
35,00	SP 500 SEP 4400.0 15.09.23 CALL	USD	9.008.858,14	-500.971,59	-108.187,51
24,00	SP 500 AUG 4320.0 18.08.23 CALL	USD	7.352.305,14	-413.125,57	-274.550,63
<b>Opzioni su futures</b>					
142,00	USD 10Y TREASU AUG 114.50 21.07.23 CALL	USD	1.671.669,29	-14.235,79	32.142,20
133,00	USD 10Y TREASU SEP 113.50 25.08.23 PUT	USD	7.946.166,07	-236.193,86	-59.299,07
142,00	USD 10Y TREASU AUG 112.00 21.07.23 PUT	USD	6.073.731,77	-75.246,33	-36.201,73
				<b>-2.690.268,00</b>	<b>-847.786,98</b>

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni acquistate</b>					
<b>Opzioni su azioni</b>					
16,00	MICRON JUL 62.500 21.07.23 CALL	USD	-	3.167,74	-2.258,61
27,00	APPLIED MAT JUL 115.00 21.07.23 CALL	USD	-	74.367,55	57.496,39
27,00	APPLIED MAT JUL 130.00 21.07.23 CALL	USD	-	39.398,72	4.187,76
16,00	DR HORTON AUG 130.00 18.08.23 CALL	USD	-	2.889,09	-501,58
48,00	APPL INC AUG 180.00 18.08.23 PUT	USD	-	7.391,38	-10.969,99
51,00	MICRON AUG 72.500 18.08.23 CALL	USD	-	2.617,78	-17.104,53
30,00	DR HORTON AUG 125.00 18.08.23 CALL	USD	-	10.174,15	1.254,31
13,00	NVIDIA CORP DEC 440.00 15.12.23 CALL	USD	-	59.935,84	9.194,24
12,00	HUMANA AUG 465.00 18.08.23 CALL	USD	-	9.239,23	-4.703,52
45,00	NVIDIA CORP SEP 430.00 15.09.23 CALL	USD	-	143.249,31	38.875,41
97,00	ALPHAB NON RG AUG 130.00 18.08.23 CALL	USD	-	17.604,03	-28.743,28
84,00	APPL INC AUG 190.00 18.08.23 CALL	USD	-	65.444,55	31.781,09
9,00	MICROSOFT JUL 305.00 21.07.23 CALL	USD	-	30.456,46	21.850,49
9,00	MICROSOFT JUL 325.00 21.07.23 CALL	USD	-	14.972,50	5.035,51
20,00	MICROSOFT JUL 340.00 21.07.23 CALL	USD	-	13.418,88	1.860,88
18,00	HILTON JUL 155.00 21.07.23 CALL	USD	-	494,96	-3.768,82
7,00	UNITEDHEALTH N JUL 520.00 21.07.23 CALL	USD	-	-	-
11,00	TESLA MOTORS AUG 210.00 18.08.23 CALL	USD	-	-	-
74,00	JPMORGAN CHASE AUG 145.00 18.08.23 CALL	USD	-	513,29	-6.130,30
-	-	-	-	57.470,21	38.319,87
-	-	-	-	28.826,76	13.566,94
45,00	ALPHAB NON RG JUL 125.00 21.07.23 CALL	USD	-	4.908,34	-9.547,81
79,00	ADVANCED MICRO JUL 125.00 21.07.23 CALL	USD	-	8.254,81	-37.881,39
6,00	ELI LILLY AND JUL 460.00 21.07.23 CALL	USD	-	8.656,28	3.606,02
8,00	NVIDIA CORP AUG 380.00 18.08.23 PUT	USD	-	5.572,87	-3.961,38
58,00	APPL INC SEP 195.00 15.09.23 CALL	USD	-	40.350,14	12.011,99
13,00	ARCHER-DANIELS SEP 82.500 15.09.23 CALL	USD	-	798,35	-1.235,61
11,00	TESLA INC AUG 260.00 18.08.23 CALL	USD	-	22.635,20	-3.250,98
22,00	MICROSOFT AUG 325.00 18.08.23 PUT	USD	-	12.502,29	-4.969,18
6,00	NVIDIA CORP AUG 420.00 18.08.23 CALL	USD	-	14.848,76	2.955,92
8,00	NVIDIA CORP JUL 250.00 21.07.23 PUT	USD	-	36,66	-12.743,13
16,00	TESLA MOTORS JUL 200.00 21.07.23 CALL	USD	-	93.198,90	78.881,89
16,00	TESLA MOTORS JUL 230.00 21.07.23 CALL	USD	-	53.528,87	18.465,70
35,00	AMAZON COM AUG 125.00 18.08.23 CALL	USD	-	32.241,06	11.265,35
11,00	MICROSOFT AUG 330.00 18.08.23 CALL	USD	-	20.376,72	11.604,39
38,00	BOSTON SCIENTI AUG 57.500 18.08.23 CALL	USD	-	1.358,39	-2.275,82
20,00	TESLA MOTORS AUG 265.00 18.08.23 CALL	USD	-	37.121,91	-5.786,18
48,00	AMAZON COM AUG 120.00 18.08.23 PUT	USD	-	10.383,13	-9.146,18
58,00	ALPHAB NON RG AUG 120.00 18.08.23 PUT	USD	-	22.328,14	-165,06
7,00	UNITEDHEALTH N AUG 480.00 18.08.23 CALL	USD	-	10.522,46	4.646,32
30,00	MICROSOFT AUG 355.00 18.08.23 CALL	USD	-	20.100,82	-2.286,21
13,00	MICROSOFT AUG 340.00 18.08.23 CALL	USD	-	16.622,36	4.505,10

					<b>Options Fund</b>		
7,00	UNITEDHEALTH N AUG 430.00 18.08.23 CALL	USD	-	1.469,29	-174,37		
49,00	APPL INC JUL 185.00 21.07.23 CALL	USD	-	45.002,75	32.673,70		
90,00	DELTA AIR LINE JUL 45.000 21.07.23 CALL	USD	-	25.572,87	5.922,39		
<hr/>							
68,00	DELTA AIR LINE JUL 35.000 21.07.23 PUT	USD	-	249,31	-62,60		
105,00	DELTA AIR LINE AUG 48.000 18.08.23 CALL	USD	-	18.959,67	3.547,54		

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su azioni</b>					
20,00	SALESFORCE JUL 220.00 21.07.23 CALL	USD	-	3.281,39	-11.175,34
62,00	AMAZON COM AUG 135.00 18.08.23 CALL	USD	-	27.277,73	784,34
10,00	MASTERCARD JUL 395.00 21.07.23 CALL	USD	-	4.445,46	-3.392,67
14,00	TESLA MOTORS JUL 260.00 21.07.23 CALL	USD	-	21.160,40	1.556,90
34,00	WALT DISNEY JUL 95.000 21.07.23 CALL	USD	-	1.121,91	-9.607,71
23,00	AMAZON COM JUL 120.00 21.07.23 CALL	USD	-	23.484,88	15.659,92
37,00	ADVANCED MICRO SEP 130.00 15.09.23 CALL	USD	-	14.277,73	-18.830,35
90,00	DELTA AIR LINE JUL 40.000 21.07.23 CALL	USD	-	62.694,78	49.475,48
41,00	ADVANCED MICRO AUG 130.00 18.08.23 CALL	USD	-	10.522,46	-17.375,19
13,00	MICROSOFT SEP 365.00 15.09.23 CALL	USD	-	8.186,07	-4.085,39
38,00	BOSTON SCIENTI AUG 55.000 18.08.23 CALL	USD	-	4.353,80	-3.236,54
46,00	AMAZON COM JUL 125.00 21.07.23 CALL	USD	-	29.514,21	16.273,11
88,00	ALPHAB NON RG JUL 130.00 21.07.23 CALL	USD	-	3.065,08	-21.564,39
				<b>1.322.618,68</b>	<b>240.324,84</b>

### Opzioni emesse

<b>Opzioni su azioni</b>					
27,00	APPLIED MAT JUL 115.00 21.07.23 CALL	USD	357.706,69	-74.367,55	-4.093,58
27,00	APPLIED MAT JUL 130.00 21.07.23 CALL	USD	318.358,96	-39.398,72	-34.128,02
18,00	ADVANCED MICRO JUL 110.00 21.07.23 CALL	USD	127.420,49	-10.905,59	-6.314,55
18,00	ADVANCED MICRO JUL 105.00 21.07.23 CALL	USD	155.610,87	-17.092,58	-10.409,78
105,00	DELTA AIR LINE AUG 55.000 18.08.23 CALL	USD	54.446,59	-2.887,26	-864,42
16,00	DR HORTON AUG 110.00 18.08.23 PUT	USD	28.018,82	-1.759,85	368,49
21,00	MICROSOFT AUG 300.00 18.08.23 PUT	USD	71.447,86	-4.061,41	1.684,86
51,00	MICRON AUG 80.000 18.08.23 CALL	USD	13.275,66	-701,19	8.090,69
110,00	AMAZON COM AUG 110.00 18.08.23 PUT	USD	123.549,26	-8.166,82	4.865,66
30,00	DR HORTON AUG 105.00 18.08.23 PUT	USD	31.788,86	-1.979,84	893,14
7,00	UNITEDHEALTH N AUG 430.00 18.08.23 PUT	USD	30.838,50	-1.469,29	4.205,77
7,00	HUMANA AUG 410.00 18.08.23 PUT	USD	43.606,44	-2.277,73	2.945,91
49,00	APPL INC JUL 185.00 21.07.23 CALL	USD	758.794,28	-45.002,75	-15.751,71
8,00	MICROSOFT SEP 300.00 15.09.23 PUT	USD	33.211,24	-2.346,47	109,66
74,00	JPMORGAN CHASE AUG 155.00 18.08.23 CALL	USD	173.621,50	-5.697,53	-3.266,77
90,00	DELTA AIR LINE JUL 45.000 21.07.23 CALL	USD	307.463,10	-25.572,87	-23.648,54
8,00	DEXCOM AUG 140.00 18.08.23 CALL	USD	28.364,08	-1.979,84	1.498,34
68,00	DELTA AIR LINE JUL 35.000 21.07.23 PUT	USD	4.740,93	-249,31	1.710,35
78,00	DELTA AIR LINE AUG 40.000 18.08.23 PUT	USD	28.890,03	-1.930,34	502,58
9,00	MICROSOFT JUL 305.00 21.07.23 CALL	USD	271.651,66	-30.456,46	-6.875,64
52,00	ALPHAB NON RG AUG 145.00 18.08.23 CALL	USD	38.053,99	-1.715,86	4.783,79
9,00	MICROSOFT JUL 325.00 21.07.23 CALL	USD	236.536,40	-14.972,50	-11.924,55
16,00	MICRON JUL 72.500 21.07.23 CALL	USD	4.720,24	-175,99	1.380,15
62,00	AMAZON COM AUG 150.00 18.08.23 CALL	USD	740.817,60	-6.705,77	64,97
23,00	AMAZON COM JUL 120.00 21.07.23 CALL	USD	249.810,86	-23.484,88	-333,63
48,00	APPL INC AUG 170.00 18.08.23 PUT	USD	68.271,75	-3.211,73	4.718,90
11,00	TESLA MOTORS AUG 210.00 18.08.23 CALL	USD	232.257,89	-57.470,21	960,88
20,00	TESLA MOTORS AUG 300.00 18.08.23 CALL	USD	142.042,02	-16.131,99	6.139,79

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Opzioni

onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

Quantità	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Valore di mercato (in EUR)	Non realizzato (in EUR)
<b>Opzioni su azioni</b>					
29,00	APPL INC SEP 170.00 15.09.23 PUT	USD	54.137,37	-3.216,32	1.045,06
8,00	NVIDIA CORP AUG 330.00 18.08.23 PUT	USD	14.578,87	-1.063,24	1.018,95
13,00	ARCHER-DANIELS SEP 60.000 15.09.23 PUT	USD	5.131,99	-268,10	569,42
25,00	JPMORGAN CHASE AUG 125.00 18.08.23 PUT	USD	19.329,79	-893,68	1.159,33
90,00	DELTA AIR LINE JUL 40.000 21.07.23 CALL	USD	376.093,25	-62.694,78	-8.201,87
13,00	NVIDIA CORP DEC 310.00 15.12.23 PUT	USD	58.974,65	-11.022,00	2.230,52
58,00	ALPHAB NON RG AUG 110.00 18.08.23 PUT	USD	106.755,20	-7.017,42	922,04
13,00	NVIDIA CORP DEC 530.00 15.12.23 CALL	USD	156.761,68	-26.679,19	-4.711,06
11,00	TESLA INC AUG 260.00 18.08.23 CALL	USD	148.898,26	-22.635,20	-14.725,28
34,00	WALT DISNEY JUL 105.00 21.07.23 CALL	USD	5.842,89	-155,82	1.658,06
46,00	AMAZON COM JUL 125.00 21.07.23 CALL	USD	413.878,07	-29.514,21	-1.946,35
37,00	ADVANCED MICRO SEP 160.00 15.09.23 CALL	USD	33.995,51	-3.120,07	7.226,21
16,00	TESLA MOTORS JUL 200.00 21.07.23 CALL	USD	366.621,96	-93.198,90	-24.149,96
16,00	TESLA MOTORS JUL 230.00 21.07.23 CALL	USD	315.947,52	-53.528,87	-48.756,53
				<b>-717.180,13</b>	<b>-159.348,72</b>

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Contratti di cambio a termine

Al 30 giugno 2023 risultavano in essere i seguenti contratti di cambio a termine:

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
HKD	11.045.000,00	USD	1.417.788,13	15/12/23	-2.511,03	BNP Paribas Parigi
USD	771.844,35	HKD	6.000.000,00	15/12/23	2.876,04	BNP Paribas Parigi
USD	759.281,94	HKD	5.900.000,00	15/12/23	3.103,51	BNP Paribas Parigi
USD	1.287.147,11	HKD	10.000.000,00	15/12/23	5.468,86	BNP Paribas Parigi
EUR	744.602,40	JPY	117.000.000,00	19/07/23	1.447,24	BNP Paribas Parigi
EUR	457.108,34	USD	500.000,00	19/07/23	-839,60	BNP Paribas Parigi
SEK	9.300.000,00	NOK	9.319.723,33	19/07/23	-8.041,62	BNP Paribas Parigi
USD	1.305.000,00	IDR	19.427.665.500,00	15/09/23	13.301,36	BOFA Securities Europe
USD	200.000,00	BRL	981.377,80	15/09/23	-744,09	BOFA Securities Europe
HKD	11.820.000,00	USD	1.515.378,20	15/12/23	-959,39	BOFA Securities Europe
CAD	5.845.000,00	EUR	4.063.494,80	19/07/23	-17.012,62	BOFA Securities Europe
CAD	800.000,00	EUR	557.929,86	19/07/23	-4.092,34	BOFA Securities Europe
EUR	319.766,70	GBP	275.000,00	19/07/23	-480,93	BOFA Securities Europe
EUR	631.389,50	USD	690.000,00	19/07/23	-578,23	BOFA Securities Europe
EUR	2.050.777,48	GBP	1.755.000,00	19/07/23	7.021,92	BOFA Securities Europe
ILS	2.650.000,00	USD	732.367,90	19/07/23	-16.484,34	BOFA Securities Europe
USD	2.644.121,90	CNH	18.775.000,00	19/07/23	55.098,45	BOFA Securities Europe
USD	37.648,73	CAD	50.000,00	19/07/23	-132,77	BOFA Securities Europe
USD	150.000,00	GBP	118.596,32	19/07/23	-726,01	BOFA Securities Europe
USD	157.000,00	EUR	144.272,46	19/07/23	-477,37	BOFA Securities Europe
USD	100.000,00	GBP	78.911,40	19/07/23	-305,91	BOFA Securities Europe
USD	681.312,13	TRY	17.295.000,00	19/07/23	18.752,93	BOFA Securities Europe
USD	640.000,00	TWD	19.718.400,00	15/09/23	5.282,41	CACIB Londra
USD	2.093.630,01	HKD	16.295.000,00	15/12/23	5.464,02	CACIB Londra
NOK	1.800.000,00	USD	166.488,28	19/07/23	1.480,50	CACIB Londra
BRL	1.650.370,20	USD	340.000,00	15/09/23	-2.149,84	Citigroup Global Markets Europe AG
CLP	1.197.021.390,00	USD	1.485.000,00	15/09/23	-5.554,43	Citigroup Global Markets Europe AG
KRW	376.167.700,00	USD	290.000,00	15/09/23	-3.070,82	Citigroup Global Markets Europe AG
USD	1.020.000,00	TWD	31.098.220,02	15/09/23	18.071,38	Citigroup Global Markets Europe AG
AUD	478.193,72	JPY	44.400.000,00	19/07/23	9.638,08	Citigroup Global Markets Europe AG
CHF	150.000,00	USD	167.480,40	19/07/23	411,76	Citigroup Global Markets Europe AG
CHF	600.000,00	EUR	613.013,04	19/07/23	2.211,59	Citigroup Global Markets Europe AG
CZK	9.500.000,00	EUR	401.687,60	19/07/23	-2.421,15	Citigroup Global Markets Europe AG
EUR	11.429,47	ILS	45.000,00	19/07/23	318,94	Citigroup Global Markets Europe AG
EUR	22.612,77	NZD	40.000,00	19/07/23	169,82	Citigroup Global Markets Europe AG
EUR	414.473,53	USD	450.000,00	19/07/23	2.322,71	Citigroup Global Markets Europe AG
EUR	184.203,77	USD	200.000,00	19/07/23	1.025,62	Citigroup Global Markets Europe AG
EUR	3.534.672,02	NZD	6.250.000,00	19/07/23	27.960,98	Citigroup Global Markets Europe AG
EUR	1.371.971,06	SEK	15.980.000,00	19/07/23	16.014,48	Citigroup Global Markets Europe AG
HUF	680.735.000,00	EUR	1.822.927,51	19/07/23	-7.115,06	Citigroup Global Markets Europe AG
HUF	100.000.000,00	EUR	267.984,65	19/07/23	-1.242,72	Citigroup Global Markets Europe AG
ILS	750.000,00	USD	210.313,79	19/07/23	-7.450,62	Citigroup Global Markets Europe AG
JPY	75.970.999,00	USD	550.000,00	19/07/23	-21.161,38	Citigroup Global Markets Europe AG
NZD	520.000,00	AUD	473.404,67	19/07/23	3.013,59	Citigroup Global Markets Europe AG
NZD	1.520.604,77	JPY	133.000.000,00	19/07/23	8.384,24	Citigroup Global Markets Europe AG
SGD	360.000,00	USD	268.479,40	19/07/23	-2.126,97	Citigroup Global Markets Europe AG
USD	817.330,58	HKD	6.400.000,00	19/07/23	400,14	Citigroup Global Markets Europe AG
USD	214.364,00	ZAR	3.900.000,00	19/07/23	7.560,79	Citigroup Global Markets Europe AG
ZAR	5.000.000,00	EUR	244.577,01	19/07/23	-2.542,80	Citigroup Global Markets Europe AG
BRL	968.512,00	USD	200.000,00	15/09/23	-1.700,49	Goldman Sachs Bank Europe SE
COP	2.184.641.100,00	USD	510.000,00	15/09/23	2.692,51	Goldman Sachs Bank Europe SE
USD	450.000,00	BRL	2.216.632,50	15/09/23	-3.295,41	Goldman Sachs Bank Europe SE
USD	267.998,04	HKD	2.085.000,00	15/12/23	800,51	Goldman Sachs Bank Europe SE

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Contratti di cambio a termine

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
AUD	700.000,00	EUR	439.887,60	19/07/23	-12.932,37	Goldman Sachs Bank Europe SE
EUR	52.984,02	AUD	85.000,00	19/07/23	1.139,32	Goldman Sachs Bank Europe SE
GBP	590.542,86	CAD	1.000.000,00	19/07/23	-4.593,74	Goldman Sachs Bank Europe SE
HKD	8.000.000,00	USD	1.023.662,73	19/07/23	-2.332,43	Goldman Sachs Bank Europe SE
ILS	2.550.000,00	USD	697.934,50	19/07/23	-9.634,73	Goldman Sachs Bank Europe SE
NOK	9.687.237,07	SEK	9.700.000,00	19/07/23	5.535,98	Goldman Sachs Bank Europe SE
USD	550.000,00	JPY	77.377.036,00	19/07/23	12.244,79	Goldman Sachs Bank Europe SE
USD	551.483,53	ZAR	10.400.000,00	19/07/23	1.660,94	Goldman Sachs Bank Europe SE
USD	197.832,70	TRY	5.000.000,00	19/07/23	6.217,08	Goldman Sachs Bank Europe SE
USD	488.448,89	CAD	660.000,00	15/09/23	-9.954,77	HSBC Continental Europe SA
HKD	1.195.000,00	EUR	141.851,82	15/12/23	-2.743,06	HSBC Continental Europe SA
AUD	987.245,94	USD	680.000,00	19/07/23	-20.661,62	HSBC Continental Europe SA
CAD	1.020.000,00	AUD	1.157.617,58	19/07/23	66,44	HSBC Continental Europe SA
CHF	150.000,00	USD	167.917,73	19/07/23	11,53	HSBC Continental Europe SA
EUR	871.233,04	GBP	750.000,00	19/07/23	-2.170,14	HSBC Continental Europe SA
EUR	205.222,52	CHF	200.000,00	19/07/23	146,91	HSBC Continental Europe SA
EUR	422.270,43	USD	454.000,00	19/07/23	6.459,17	HSBC Continental Europe SA
EUR	386.990,88	MXN	7.310.000,00	19/07/23	-2.211,71	HSBC Continental Europe SA
EUR	283.154,01	MXN	5.323.000,00	19/07/23	-250,60	HSBC Continental Europe SA
EUR	182.591,17	USD	200.000,00	19/07/23	-588,21	HSBC Continental Europe SA
HKD	7.800.000,00	USD	997.682,43	19/07/23	-1.917,91	HSBC Continental Europe SA
SGD	500.000,00	USD	371.512,15	19/07/23	-1.693,69	HSBC Continental Europe SA
USD	97.758,07	CNH	700.000,00	19/07/23	1.299,57	HSBC Continental Europe SA
USD	350.000,00	AUD	523.038,34	19/07/23	1.541,43	HSBC Continental Europe SA
USD	200.545,71	THB	7.100.000,00	19/07/23	-12,90	HSBC Continental Europe SA
INR	16.487.480,00	USD	200.000,00	15/09/23	403,69	J.P. Morgan AG
EUR	127.719,37	NOK	1.482.000,00	19/07/23	954,26	J.P. Morgan AG
GBP	200.000,00	EUR	232.952,02	19/07/23	-44,91	J.P. Morgan AG
NOK	2.350.000,00	USD	220.048,64	19/07/23	-530,41	J.P. Morgan AG
USD	550.000,00	AUD	827.813,07	19/07/23	-1.176,50	J.P. Morgan AG
BRL	9.578.638,50	USD	1.915.000,00	15/09/23	41.695,40	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
COP	4.514.475.000,00	USD	1.050.000,00	15/09/23	9.205,67	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	860.000,00	IDR	12.954.180.000,00	15/09/23	-482,72	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	490.000,00	INR	40.274.570,00	15/09/23	348,98	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
AUD	1.385.056,04	USD	940.000,00	19/07/23	-16.149,87	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
AUD	634.213,65	NZD	700.000,00	19/07/23	-5.925,88	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
AUD	1.160.217,18	USD	790.000,00	19/07/23	-15.904,06	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
CAD	193.000,00	EUR	133.747,56	19/07/23	-133,81	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
CAD	300.000,00	USD	226.995,19	19/07/23	-213,93	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
CAD	90.000,00	USD	68.121,00	19/07/23	-84,75	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
CHF	100.000,00	USD	111.333,34	19/07/23	567,60	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
CHF	1.000.000,00	EUR	1.023.674,73	19/07/23	1.701,29	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	17.521,87	GBP	15.000,00	19/07/23	53,87	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	105.461,20	GBP	90.000,00	19/07/23	653,42	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	1.154.733,68	USD	1.270.000,00	19/07/23	-8.458,91	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	296.833,41	JPY	46.205.000,00	19/07/23	3.346,23	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	245.822,29	NZD	436.000,00	19/07/23	1.193,50	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	115.782,88	AUD	187.000,00	19/07/23	1.724,31	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	478.812,77	GBP	410.000,00	19/07/23	1.354,02	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	58.202,23	GBP	50.000,00	19/07/23	-24,57	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	197.680,85	SEK	2.300.000,00	19/07/23	2.518,16	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	205.077,89	CHF	200.000,00	19/07/23	2,40	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	280.358,05	PLN	1.250.000,00	19/07/23	-1.202,33	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	126.808,59	CAD	182.000,00	19/07/23	810,49	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	186.886,72	GBP	160.000,00	19/07/23	561,37	Morgan Stanley Europe SE (FXO)



# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Contratti di cambio a termine

onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
GBP	118.092,30	USD	150.000,00	19/07/23	138,61	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
ILS	700.000,00	USD	196.105,13	19/07/23	-6.781,89	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
JPY	29.800.000,00	USD	212.050,70	19/07/23	-4.926,81	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
MXN	3.400.000,00	USD	197.052,19	19/07/23	543,84	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NOK	5.900.000,00	EUR	512.667,63	19/07/23	-8.003,06	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NOK	2.800.000,00	EUR	243.444,27	19/07/23	-3.942,47	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NZD	1.750.000,00	AUD	1.595.284,52	19/07/23	8.862,56	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NZD	700.000,00	AUD	641.419,77	19/07/23	1.526,90	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NZD	357.696,82	USD	220.000,00	19/07/23	-801,78	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NZD	323.844,16	USD	200.000,00	19/07/23	-1.478,37	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NZD	401.648,36	USD	250.000,00	19/07/23	-3.620,54	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NZD	1.345.189,27	USD	819.909,00	19/07/23	3.808,10	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	366.633,25	TRY	9.400.000,00	19/07/23	6.819,14	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	313.015,20	ILS	1.150.000,00	19/07/23	2.751,21	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	100.000,00	GBP	80.183,16	19/07/23	-1.788,04	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	204.285,40	JPY	29.500.000,00	19/07/23	-271,61	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	75.610,39	CAD	100.000,00	19/07/23	21,21	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	215.090,89	MXN	3.700.000,00	19/07/23	7,37	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	28.727,06	ZAR	550.000,00	19/07/23	-314,18	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	221.193,68	MXN	3.800.000,00	19/07/23	273,75	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
USD	100.000,00	GBP	79.361,31	19/07/23	-830,24	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
ZAR	5.700.000,00	USD	304.560,94	19/07/23	-3.026,81	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
ZAR	4.200.000,00	USD	222.876,73	19/07/23	-819,69	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
KRW	1.113.947.336,00	USD	860.000,00	15/09/23	-10.208,78	Royal Bank of Canada, Londra
USD	700.000,00	AUD	1.059.495,20	15/09/23	-6.129,60	Royal Bank of Canada, Londra
CHF	1.815.000,00	EUR	1.872.788,64	19/07/23	-11.719,05	Royal Bank of Canada, Londra
EUR	115.964,54	USD	125.000,00	19/07/23	1.478,83	Royal Bank of Canada, Londra
EUR	837.492,53	USD	906.000,00	19/07/23	7.697,84	Royal Bank of Canada, Londra
NZD	1.116.539,95	USD	680.091,00	19/07/23	3.576,48	Royal Bank of Canada, Londra
USD	327.689,23	JPY	46.750.000,00	19/07/23	3.180,52	Royal Bank of Canada, Londra
USD	200.000,00	GBP	159.408,77	19/07/23	-2.460,13	Royal Bank of Canada, Londra
KRW	256.902.000,00	USD	200.000,00	15/09/23	-3.873,57	Société Générale
CHF	1.039.000,00	EUR	1.071.081,79	19/07/23	-5.709,98	Société Générale
CHF	50.000,00	USD	55.852,77	19/07/23	113,48	Société Générale
EUR	313.961,15	GBP	270.000,00	19/07/23	-463,79	Société Générale
EUR	491.664,36	NOK	5.800.000,00	19/07/23	-4.449,10	Société Générale
EUR	770.044,25	CHF	750.000,00	19/07/23	1.010,37	Société Générale
EUR	886.610,14	USD	960.000,00	19/07/23	7.356,90	Société Générale
EUR	962.400,25	AUD	1.570.000,00	19/07/23	4.793,27	Société Générale
EUR	2.036.048,19	NOK	24.030.000,00	19/07/23	-19.401,38	Société Générale
EUR	274.362,60	USD	300.000,00	19/07/23	-406,10	Société Générale
EUR	684.410,75	CHF	670.000,00	19/07/23	-2.589,99	Société Générale
MXN	45.050.000,00	USD	2.579.151,00	19/07/23	36.433,44	Société Générale
NOK	5.400.000,00	EUR	467.885,71	19/07/23	-5.989,05	Société Générale
NOK	5.628.616,76	SEK	5.700.000,00	19/07/23	-2.211,63	Société Générale
USD	280.077,65	CHF	250.000,00	19/07/23	177,31	Société Générale
USD	200.000,00	EUR	182.806,73	19/07/23	372,48	Société Générale
USD	200.000,00	GBP	155.960,84	19/07/23	1.558,15	Société Générale
USD	628.096,35	SGD	845.000,00	19/07/23	3.082,94	Société Générale
ZAR	9.100.000,00	USD	495.386,47	19/07/23	-13.238,95	Société Générale
INR	198.006.720,00	USD	2.390.000,00	15/09/23	15.788,62	Standard Chartered Bank AG
INR	32.124.768,00	USD	390.000,00	15/09/23	498,75	Standard Chartered Bank AG
PHP	8.980.000,00	USD	160.000,00	15/09/23	1.920,36	Standard Chartered Bank AG
PHP	10.571.030,00	USD	190.000,00	15/09/23	740,81	Standard Chartered Bank AG
EUR	298.805,08	DKK	2.225.000,00	19/07/23	-63,30	Standard Chartered Bank AG

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Contratti di cambio a termine

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
EUR	930.576,33	HKD	8.000.000,00	19/07/23	-4.662,08	Standard Chartered Bank AG
EUR	356.795,39	RON	1.775.000,00	19/07/23	-676,00	Standard Chartered Bank AG
EUR	212.208,19	TRY	5.600.000,00	19/07/23	16.276,35	Standard Chartered Bank AG
EUR	262.515,98	SEK	3.077.000,00	19/07/23	1.422,10	Standard Chartered Bank AG
EUR	18.632,25	AUD	30.000,00	19/07/23	334,10	Standard Chartered Bank AG
GBP	513.291,49	USD	650.000,00	19/07/23	2.416,57	Standard Chartered Bank AG
USD	652.623,40	SGD	880.000,00	19/07/23	1.846,81	Standard Chartered Bank AG
USD	1.066.016,82	THB	36.920.000,00	19/07/23	21.146,28	Standard Chartered Bank AG
USD	216.512,56	NOK	2.350.000,00	19/07/23	-2.708,93	State Street Bank Intl GmbH
USD	218.161,27	SEK	2.350.000,00	19/07/23	407,29	State Street Bank Intl GmbH
KRW	385.698.720,00	USD	300.000,00	15/09/23	-5.569,87	UBS Europe SE
NOK	5.159.671,18	SEK	5.000.000,00	15/09/23	16.750,35	UBS Europe SE
PHP	7.815.178,00	USD	140.000,00	15/09/23	977,56	UBS Europe SE
PLN	816.515,83	HUF	70.000.000,00	15/09/23	-788,53	UBS Europe SE
USD	200.000,00	PHP	11.099.700,00	15/09/23	-319,84	UBS Europe SE
CHF	1.500.000,00	EUR	1.531.976,95	19/07/23	6.084,18	UBS Europe SE
CZK	59.615.000,00	EUR	2.516.513,63	19/07/23	-11.005,43	UBS Europe SE
CZK	4.500.000,00	EUR	190.093,99	19/07/23	-967,51	UBS Europe SE
EUR	818.637,39	CZK	19.500.000,00	19/07/23	-918,18	UBS Europe SE
EUR	515.487,12	JPY	76.730.000,00	19/07/23	28.073,94	UBS Europe SE
EUR	107.197,06	ZAR	2.153.000,00	19/07/23	2.981,45	UBS Europe SE
EUR	425.624,71	GBP	365.000,00	19/07/23	569,55	UBS Europe SE
EUR	1.307.774,83	CAD	1.881.000,00	19/07/23	5.562,21	UBS Europe SE
EUR	707.929,74	CHF	690.000,00	19/07/23	418,98	UBS Europe SE
EUR	314.025,25	CZK	7.500.000,00	19/07/23	-1.189,65	UBS Europe SE
EUR	429.917,77	CHF	420.000,00	19/07/23	-740,13	UBS Europe SE
EUR	8.363.164,12	USD	8.990.000,00	19/07/23	129.369,69	UBS Europe SE
EUR	233.438,69	GBP	200.000,00	19/07/23	531,90	UBS Europe SE
EUR	476.976,28	PLN	2.145.000,00	19/07/23	-6.187,76	UBS Europe SE
EUR	614.706,86	CHF	600.000,00	19/07/23	-519,16	UBS Europe SE
EUR	261.366,58	RON	1.300.000,00	19/07/23	-443,39	UBS Europe SE
ILS	350.000,00	USD	97.570,98	19/07/23	-2.949,70	UBS Europe SE
JPY	80.841.000,00	EUR	538.181,16	19/07/23	-24.661,43	UBS Europe SE
JPY	100.000.000,00	GBP	574.116,09	19/07/23	-33.352,86	UBS Europe SE
NOK	5.800.000,00	EUR	499.384,81	19/07/23	-3.272,93	UBS Europe SE
NOK	6.700.000,00	EUR	574.037,76	19/07/23	-942,42	UBS Europe SE
SEK	3.400.000,00	NOK	3.376.160,93	19/07/23	-283,89	UBS Europe SE
SGD	700.000,00	USD	521.537,25	19/07/23	-3.672,21	UBS Europe SE
USD	1.473.611,65	ILS	5.370.000,00	19/07/23	23.811,36	UBS Europe SE
USD	112.471,77	CAD	150.000,00	19/07/23	-833,08	UBS Europe SE
USD	403.468,95	CZK	8.819.000,00	19/07/23	-1.115,37	UBS Europe SE
					<b>228.677,40</b>	

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
IDR	21.950.000.000,00	USD	1.471.704,39	07/09/23	-12.373,60	BNP Paribas Parigi
USD	2.096.250,08	TWD	63.800.000,00	11/08/23	44.154,71	BNP Paribas Parigi
EUR	1.168.299,29	DKK	8.700.000,00	06/07/23	-144,98	BOFA Securities Europe
USD	550.161,28	TWD	16.800.000,00	11/08/23	9.949,84	BOFA Securities Europe
USD	409.770,76	KRW	540.000.000,00	11/08/23	-797,83	BOFA Securities Europe
EUR	2.271.792,51	CHF	2.200.000,00	13/07/23	16.735,27	BOFA Securities Europe
EUR	370.268,66	AUD	600.000,00	26/07/23	4.360,11	BOFA Securities Europe
EUR	15.177.571,75	GBP	13.000.000,00	27/07/23	44.139,32	BOFA Securities Europe

## onemarkets Fund

### Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

#### Contratti di cambio a termine

##### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
EUR	15.184.485,66	GBP	13.000.000,00	27/07/23	51.060,26	BOFA Securities Europe
GBP	12.500.000,00	EUR	14.535.407,67	27/07/23	16.029,07	BOFA Securities Europe
CNY	23.700.000,00	USD	3.327.118,97	27/09/23	-34.797,99	BOFA Securities Europe
BRL	23.200.000,00	USD	4.651.162,79	17/07/23	134.692,21	CACIB Londra
PHP	68.600.000,00	USD	1.254.457,35	12/07/23	-13.036,81	Citigroup Global Markets Europe AG
USD	1.163.915,05	PHP	65.000.000,00	12/07/23	-10.342,62	Citigroup Global Markets Europe AG
INR	83.300.000,00	USD	1.006.572,33	13/09/23	5.681,40	Citigroup Global Markets Europe AG
EUR	2.588.952,27	PLN	11.600.000,00	17/07/23	-24.520,19	Citigroup Global Markets Europe AG
USD	1.383.031,57	CNY	9.900.000,00	27/09/23	8.373,09	Citigroup Global Markets Europe AG
JPY	800.000.000,00	EUR	5.163.435,31	05/07/23	-89.597,45	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
JPY	140.000.000,00	EUR	887.464,38	05/07/23	455,62	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	671.021,14	DKK	5.000.000,00	06/07/23	-498,55	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	1.496.999,47	SEK	17.400.000,00	07/07/23	20.473,29	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	702.900,42	SEK	8.300.000,00	07/07/23	-1.419,69	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NOK	34.900.000,00	EUR	2.956.962,45	07/07/23	28.750,07	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
KRW	1.910.000.000,00	USD	1.452.934,43	11/08/23	-434,64	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
NZD	400.000,00	EUR	226.899,25	12/07/23	-2.378,78	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	295.157,98	HUF	110.000.000,00	14/07/23	1.236,66	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
HUF	420.000.000,00	EUR	1.133.018,53	14/07/23	-10.793,70	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
MXN	28.300.000,00	EUR	1.517.220,21	19/07/23	-10.530,16	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	1.056.268,52	ZAR	21.200.000,00	21/07/23	30.431,00	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
EUR	3.403.235,80	USD	3.700.000,00	31/07/23	16.624,91	Morgan Stanley Europe SE (FXO)
HUF	120.000.000,00	EUR	319.923,99	14/07/23	724,34	Natixis
EUR	627.240,21	CAD	900.000,00	02/08/23	4.501,49	Royal Bank of Canada, Londra
EUR	2.048.229,66	CHF	2.000.000,00	13/07/23	-1.814,32	Royal Bank of Canada, Londra
EUR	3.867.957,51	HKD	33.100.000,00	25/07/23	-898,15	Royal Bank of Canada, Londra
BRL	4.100.000,00	USD	836.990,92	17/07/23	10.004,81	Société Générale
BRL	3.300.000,00	USD	647.312,67	17/07/23	32.274,66	Société Générale
EUR	202.115,05	PLN	900.000,00	17/07/23	-652,69	Société Générale
EUR	92.947.922,65	USD	102.000.000,00	31/07/23	-413.923,53	Société Générale
NZD	2.600.000,00	EUR	1.474.443,22	12/07/23	-15.059,99	Standard Chartered Bank AG
CZK	24.600.000,00	EUR	1.038.755,20	03/08/23	-6.419,49	State Street Bank Intl GmbH
JPY	500.000.000,00	EUR	3.345.173,69	05/07/23	-174.013,16	State Street Bank Intl GmbH
JPY	50.000.000,00	EUR	327.001,69	05/07/23	-9.886,39	State Street Bank Intl GmbH
NOK	2.200.000,00	EUR	190.508,45	07/07/23	-2.297,52	State Street Bank Intl GmbH
TWD	57.600.000,00	USD	1.889.174,96	11/08/23	-36.779,49	State Street Bank Intl GmbH
					<b>-392.759,59</b>	

##### onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
DKK	4.209.850,00	USD	625.615,24	20/09/23	-5.297,70	Bank of America Global Foreign Exchge
JPY	254.656.476,00	USD	1.931.099,28	20/09/23	-133.837,02	Bank of America Global Foreign Exchge
AUD	3.340.661,00	USD	2.268.823,28	20/09/23	-36.933,32	Barclays Bank PLC
CAD	1.790.351,00	USD	1.351.822,39	20/09/23	2.531,84	BNP Paribas Parigi
TWD	47.371.061,00	USD	1.525.726,48	20/09/23	-1.324,69	BNP Paribas Parigi
CAD	508.255,00	USD	378.300,47	20/09/23	5.719,66	Citibank NA (Londra)
USD	431.373,58	EUR	400.117,00	20/09/23	-6.280,07	Citibank NA (Londra)
USD	397.206,62	EUR	365.212,00	20/09/23	-2.556,43	Citibank NA (Londra)
MXN	2.924.955,00	USD	161.721,94	20/09/23	5.872,33	Goldman Sachs Int finance Ltd
CAD	3.207.740,00	USD	2.406.024,13	20/09/23	19.195,08	HSBC Bank Plc
TWD	58.914.369,00	USD	1.946.263,49	20/09/23	-46.235,72	HSBC Bank Plc

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Contratti di cambio a termine

#### onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
USD	3.359.749,85	EUR	3.069.015,00	20/09/23	-1.435,11	HSBC Bank Plc
BRL	2.115.039,00	USD	416.157,84	20/09/23	15.091,62	Morgan Stanley Co Intl Ltd
CNY	3.571.251,00	USD	520.000,03	20/09/23	-22.462,68	Morgan Stanley Co Intl Ltd
USD	377.721,60	EUR	345.355,00	20/09/23	-482,00	Morgan Stanley Co Intl Ltd
AUD	1.456.204,00	USD	963.342,58	20/09/23	7.405,87	Royal Bank of Canada, Londra
CHF	470.328,00	USD	536.342,66	20/09/23	-5.743,03	Royal Bank of Canada, Londra
INR	105.869.145,00	USD	1.286.646,63	20/09/23	168,44	Royal Bank of Canada, Londra
SEK	7.932.151,00	USD	780.161,52	20/09/23	-39.345,61	Royal Bank of Canada, Londra
USD	1.108.866,96	CHF	986.580,00	20/09/23	-2.670,55	Royal Bank of Canada, Londra
USD	3.732.502,93	GBP	2.950.591,00	20/09/23	-17.847,73	Royal Bank of Canada, Londra
USD	488.846,56	EUR	444.348,00	20/09/23	1.996,12	Royal Bank of Canada, Londra
USD	594.311,14	EUR	539.379,00	20/09/23	3.263,39	Royal Bank of Canada, Londra
USD	14.927.561,47	EUR	13.505.842,00	20/09/23	124.096,94	Royal Bank of Scotland London
HKD	9.024.261,00	USD	1.154.228,39	20/09/23	-561,11	State Street Bank and Trust
INR	154.365.227,00	USD	1.870.864,17	20/09/23	4.992,44	State Street Bank and Trust
ZAR	2.698.321,00	USD	141.338,12	20/09/23	350,23	State Street Bank and Trust
AUD	720.407,00	USD	487.139,93	20/09/23	-6.014,68	Toronto-Dominion Bank
JPY	50.450.225,00	USD	376.421,04	20/09/23	-20.944,50	Toronto-Dominion Bank
SEK	5.211.006,00	USD	489.013,90	20/09/23	-4.377,08	Toronto-Dominion Bank
USD	488.714,87	GBP	383.755,00	20/09/23	670,56	Toronto-Dominion Bank
HKD	14.023.771,00	USD	1.796.882,70	20/09/23	-3.802,49	UBS Ltd London
KRW	2.206.057.520,00	USD	1.684.000,52	20/09/23	-2.367,13	UBS Ltd London
					<b>-169.164,13</b>	

#### onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
BRL	52.866,22	USD	11.000,00	05/07/23	-39,46	Barclays Bank PLC
BRL	55.489,50	USD	11.000,00	05/07/23	458,98	Barclays Bank PLC
USD	77.225,02	ZAR	1.432.835,34	14/08/23	1.562,78	Barclays Bank PLC
USD	182.322,00	ZAR	3.369.930,45	15/08/23	4.330,27	Barclays Bank PLC
USD	143.274,87	ZAR	2.782.790,55	15/08/23	-3.127,03	Barclays Bank PLC
EUR	130.812,65	JPY	20.300.000,00	16/08/23	1.482,12	Barclays Bank PLC
EUR	789.303,65	USD	870.000,00	16/08/23	-6.410,38	Barclays Bank PLC
EUR	345.651,44	USD	379.000,00	16/08/23	-983,27	Barclays Bank PLC
EUR	1.003.515,34	USD	1.090.000,00	16/08/23	6.618,12	Barclays Bank PLC
EUR	218.190,43	JPY	33.200.000,00	16/08/23	6.655,15	Barclays Bank PLC
EUR	902.622,74	USD	981.000,00	16/08/23	5.414,06	Barclays Bank PLC
EUR	450.950,77	USD	495.000,00	16/08/23	-1.779,01	Barclays Bank PLC
EUR	195.143,66	JPY	30.000.000,00	16/08/23	4.006,50	Barclays Bank PLC
EUR	3.867.258,83	JPY	567.400.000,00	16/08/23	251.415,42	Barclays Bank PLC
EUR	731.992,59	USD	802.000,00	16/08/23	-1.518,15	Barclays Bank PLC
EUR	178.559,00	SEK	1.999.334,10	16/08/23	8.924,16	Barclays Bank PLC
EUR	107.670,73	GBP	94.000,00	16/08/23	-1.658,70	Barclays Bank PLC
EUR	2.445.613,27	USD	2.670.000,00	16/08/23	3.645,05	Barclays Bank PLC
EUR	437.815,10	USD	478.000,00	16/08/23	638,73	Barclays Bank PLC
EUR	70.101,62	JPY	10.400.000,00	16/08/23	3.829,58	Barclays Bank PLC
EUR	288.221,76	DKK	2.145.000,00	16/08/23	4,13	Barclays Bank PLC
EUR	26.680,47	AUD	44.000,00	16/08/23	-140,94	Barclays Bank PLC
EUR	67.225,77	GBP	58.000,00	16/08/23	-231,27	Barclays Bank PLC
EUR	101.140,02	JPY	15.600.000,00	16/08/23	1.750,22	Barclays Bank PLC
USD	417.000,00	EUR	384.858,57	16/08/23	-3.478,84	Barclays Bank PLC
USD	199.000,00	EUR	185.059,14	16/08/23	-3.060,83	Barclays Bank PLC
USD	220.000,00	EUR	203.653,02	16/08/23	-2.446,82	Barclays Bank PLC

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Contratti di cambio a termine

onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
USD	360.000,00	EUR	332.980,10	16/08/23	-3.733,01	Barclays Bank PLC
USD	19.694,34	ZAR	378.773,36	18/08/23	-243,00	Barclays Bank PLC
USD	89.905,76	ILS	319.147,83	20/09/23	3.342,89	Barclays Bank PLC
USD	108.351,00	ILS	387.579,98	20/09/23	3.298,82	Barclays Bank PLC
USD	25.000,00	KRW	32.824.750,00	20/09/23	-16,69	Barclays Bank PLC
USD	83.287,34	HUF	28.715.000,00	22/08/23	342,18	Barclays Bank PLC
BRL	61.050,12	USD	12.000,00	05/07/23	598,77	Citibank NA
USD	2.665,70	MXN	46.000,00	14/07/23	-10,22	Citibank NA
EUR	43.254,74	AUD	69.000,00	16/08/23	1.195,19	Citibank NA
EUR	137.545,77	JPY	20.400.000,00	16/08/23	7.550,45	Citibank NA
EUR	458.587,08	USD	493.000,00	16/08/23	7.707,11	Citibank NA
EUR	6.610.544,52	USD	7.233.000,00	16/08/23	-4.751,76	Citibank NA
EUR	346.533,27	USD	380.000,00	16/08/23	-1.016,11	Citibank NA
EUR	687.181,73	USD	737.000,00	16/08/23	13.151,73	Citibank NA
EUR	6.859.845,30	USD	7.368.000,00	16/08/23	121.352,46	Citibank NA
EUR	29.109,18	NOK	345.000,00	16/08/23	-390,20	Citibank NA
EUR	14.780,84	DKK	110.000,00	16/08/23	0,45	Citibank NA
EUR	362.543,18	USD	395.000,00	16/08/23	1.279,83	Citibank NA
USD	216.000,00	EUR	198.887,68	16/08/23	-1.337,46	Citibank NA
USD	10.387,53	MXN	189.000,00	18/07/23	-552,85	Citibank NA
KRW	1.215.002.029,00	USD	944.894,49	20/09/23	-17.201,81	Citibank NA
USD	4.240,93	MXN	79.000,00	25/09/23	-273,04	Citibank NA
BRL	53.558,67	USD	11.000,00	02/08/23	39,81	Goldman Sachs Capital Markets NY
BRL	1.159.775,91	USD	215.319,59	05/07/23	22.967,95	Goldman Sachs Capital Markets NY
EUR	54.000,00	GBP	46.364,40	05/07/23	-26,07	Goldman Sachs Capital Markets NY
USD	8.000,00	BRL	38.199,68	05/07/23	75,91	Goldman Sachs Capital Markets NY
USD	297.139,39	BRL	1.434.737,54	05/07/23	-203,23	Goldman Sachs Capital Markets NY
USD	10.000,00	BRL	51.375,70	05/07/23	-594,09	Goldman Sachs Capital Markets NY
BRL	1.450.634,50	USD	297.139,39	05/09/23	167,01	Goldman Sachs Capital Markets NY
USD	16.082,55	MXN	277.000,00	14/07/23	-33,64	Goldman Sachs Capital Markets NY
USD	20.463,25	MXN	353.000,00	14/07/23	-72,11	Goldman Sachs Capital Markets NY
CHF	65.000,00	EUR	66.610,42	16/08/23	142,39	Goldman Sachs Capital Markets NY
EUR	1.702,25	NOK	20.000,00	16/08/23	-7,85	Goldman Sachs Capital Markets NY
EUR	304.946,13	DKK	2.270.000,00	16/08/23	-67,36	Goldman Sachs Capital Markets NY
EUR	1.104.021,01	AUD	1.798.000,00	16/08/23	8.013,41	Goldman Sachs Capital Markets NY
EUR	59.752,27	NZD	104.000,00	16/08/23	1.492,93	Goldman Sachs Capital Markets NY
EUR	435.882,49	JPY	67.400.000,00	16/08/23	6.472,57	Goldman Sachs Capital Markets NY
USD	205.078,13	SGD	272.166,88	17/07/23	3.548,31	Goldman Sachs Capital Markets NY
USD	71.970,00	ZAR	1.350.193,19	19/10/23	1.168,93	Goldman Sachs Capital Markets NY
HKD	3.192.000,00	USD	408.546,44	20/09/23	-455,26	Goldman Sachs Capital Markets NY
USD	282.094,14	HKD	2.204.000,00	20/09/23	316,68	Goldman Sachs Capital Markets NY
EUR	433.000,00	HKD	3.705.570,70	05/07/23	-398,84	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	154.000,00	JPY	24.270.862,00	05/07/23	67,24	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
USD	41.466,98	MXN	797.870,31	14/07/23	-4.557,74	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	20.658,69	GBP	18.000,00	16/08/23	-276,65	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	318.554,41	USD	345.000,00	16/08/23	3.024,74	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	489.625,55	JPY	75.900.000,00	16/08/23	6.067,14	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	301.908,44	JPY	44.300.000,00	16/08/23	19.600,04	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	17.147,03	AUD	28.000,00	16/08/23	79,02	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt

## onemarkets Fund

### Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

#### Contratti di cambio a termine

##### onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato) (in EUR	Controparte
EUR	731.618,41	USD	794.000,00	16/08/23	5.439,57	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	177.897,55	GBP	155.000,00	16/08/23	-2.379,00	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	608.507,59	USD	666.000,00	16/08/23	-615,89	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	126.144,87	CHF	122.000,00	16/08/23	852,32	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	97.484,41	AUD	159.000,00	16/08/23	562,58	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	276.732,49	JPY	43.300.000,00	16/08/23	880,26	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	25.470,51	JPY	3.800.000,00	16/08/23	1.256,38	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	39.554,16	AUD	63.000,00	16/08/23	1.152,02	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	14.644,00	AUD	24.000,00	16/08/23	14,22	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	22.269,45	CAD	32.000,00	16/08/23	137,69	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	69.667,48	JPY	10.400.000,00	16/08/23	3.397,41	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	1.673.635,21	USD	1.809.000,00	16/08/23	19.169,45	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
USD	144.798,12	MXN	2.509.351,42	16/08/23	-255,53	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
USD	330.000,00	EUR	307.758,02	16/08/23	-5.953,69	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
USD	4.778.000,00	EUR	4.428.610,53	16/08/23	-58.790,01	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
HKD	1.309.000,00	USD	167.436,57	20/09/23	-92,17	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
KRW	14.231.784,00	USD	11.000,00	20/09/23	-139,52	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
KRW	14.471.807,00	USD	11.000,00	20/09/23	27,45	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
KRW	15.496.399,00	USD	12.000,00	20/09/23	-172,50	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
KRW	14.131.887,00	USD	11.000,00	20/09/23	-209,01	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
KRW	14.329.339,00	USD	11.000,00	20/09/23	-71,65	Royal Bank of Canada, Capital Mkt Dpt
EUR	26.666,54	GBP	23.000,00	16/08/23	-83,66	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	433.658,43	USD	478.000,00	16/08/23	-3.526,99	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	151.598,48	JPY	22.300.000,00	16/08/23	9.490,10	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	30.723,38	NOK	360.000,00	16/08/23	-58,38	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	261.156,62	NOK	3.020.000,00	16/08/23	2.933,78	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	200.120,28	CHF	194.000,00	16/08/23	885,70	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	83.505,07	CHF	81.000,00	16/08/23	319,62	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	69.258,74	JPY	10.300.000,00	16/08/23	3.624,70	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	10.748,34	DKK	80.000,00	16/08/23	-1,04	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	86.758,86	GBP	75.000,00	16/08/23	-470,42	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	433.386,61	USD	465.000,00	16/08/23	8.116,27	Royal Bank of Scotland Londer
EUR	45.517,36	GBP	39.000,00	16/08/23	158,92	Royal Bank of Scotland Londer
GBP	114.000,00	EUR	131.634,10	16/08/23	954,86	Royal Bank of Scotland Londer
USD	371.000,00	EUR	341.713,45	16/08/23	-2.402,88	Royal Bank of Scotland Londer
USD	150.000,00	EUR	138.277,01	16/08/23	-1.089,71	Royal Bank of Scotland Londer
USD	162.000,00	EUR	148.378,96	16/08/23	-214,58	Royal Bank of Scotland Londer
USD	6.652.000,00	EUR	6.056.748,79	16/08/23	27.214,99	Royal Bank of Scotland Londer

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Contratti di cambio a termine

onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

Valuta acquistata	Quantità acquistata	Valuta venduta	Quantità venduta	Data di scadenza	Non realizzato (in EUR)	Controparte
AUD	16.373,80	EUR	10.000,00	05/07/23	-10,08	Société Générale
BRL	53.023,30	USD	11.000,00	05/07/23	-9,61	Société Générale
EUR	41.513,12	JPY	6.400.000,00	16/08/23	737,73	Société Générale
EUR	151.593,07	GBP	130.000,00	16/08/23	398,00	Société Générale
EUR	19.478,77	GBP	17.000,00	16/08/23	-293,57	Société Générale
EUR	26.294,16	GBP	23.000,00	16/08/23	-456,75	Société Générale
EUR	620.792,15	USD	674.000,00	16/08/23	4.362,71	Société Générale
USD	391.000,00	EUR	361.257,36	16/08/23	-3.657,57	Société Générale
USD	9.752,42	SGD	13.000,00	17/07/23	130,00	Société Générale
BRL	44.504,10	USD	9.000,00	05/07/23	205,20	Standard Chartered Bank Londra
BRL	53.903,30	USD	11.000,00	05/07/23	157,59	Standard Chartered Bank Londra
BRL	53.820,80	USD	11.000,00	05/07/23	141,92	Standard Chartered Bank Londra
KRW	15.600.960,00	USD	12.000,00	20/09/23	-99,76	Standard Chartered Bank Londra
CAD	51.828,12	EUR	36.000,00	05/07/23	-101,66	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	25.000,00	CHF	24.414,75	05/07/23	-15,11	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	10.000,00	MXN	186.981,00	05/07/23	9,40	Standard Chartered BK Plc Londra
CAD	181.000,00	EUR	124.621,08	16/08/23	563,69	Standard Chartered BK Plc Londra
CHF	68.000,00	EUR	69.749,24	16/08/23	84,62	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	31.986.917,25	USD	34.996.796,60	16/08/23	-21.122,09	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	195.337,73	JPY	30.700.000,00	16/08/23	-239,47	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	3.392.331,93	GBP	2.963.976,75	16/08/23	-55.012,33	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	658.699,79	GBP	570.000,00	16/08/23	-4.243,98	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	404.587,32	GBP	348.000,00	16/08/23	-152,58	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	186.816,21	GBP	161.000,00	16/08/23	-434,86	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	4.497.804,00	GBP	3.927.512,14	16/08/23	-70.204,51	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	749.334,15	USD	811.000,00	16/08/23	7.611,88	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	26.209,06	DKK	195.000,00	16/08/23	7,46	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	375.611,39	USD	403.000,00	16/08/23	7.043,79	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	833.062,18	USD	893.000,00	16/08/23	16.361,91	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	173.737,33	GBP	150.000,00	16/08/23	-720,80	Standard Chartered BK Plc Londra
EUR	210.985,71	GBP	181.000,00	16/08/23	475,51	Standard Chartered BK Plc Londra
JPY	17.100.000,00	EUR	115.759,86	16/08/23	-6.791,08	Standard Chartered BK Plc Londra
JPY	21.100.000,00	EUR	141.835,77	16/08/23	-7.381,78	Standard Chartered BK Plc Londra
USD	2.110.000,00	EUR	1.957.948,46	16/08/23	-28.208,40	Standard Chartered BK Plc Londra
					<b>321.902,62</b>	

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Futures finanziari

Al 30 giugno 2023 erano in essere i seguenti contratti futures:

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità Acquisto/ (Vendita)	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Guadagno/ (perdita) non realizzato/a (in EUR)	Broker
<b>Futures su indice</b>					
8,00	CAC40 10 EURO 07/23	EUR	592.004,80	-274,80	CACEIS Bank, Parigi
31,00	CBOE VIX FUTURE 07/23	USD	386.150,32	-97.652,61	CACEIS Bank, Parigi
-17,00	CBOE VIX FUTURE 09/23	USD	211.759,85	19.429,24	CACEIS Bank, Parigi
2,00	DAX INDEX GERMANY 09/23	EUR	807.395,00	7.038,13	CACEIS Bank, Parigi
27,00	DJ.STOX 600 INDUS 09/23	EUR	994.531,50	3.860,00	CACEIS Bank, Parigi
25,00	DJ.STOXX600.BK(EUX) 09/23	EUR	194.462,50	1.787,50	CACEIS Bank, Parigi
-73,00	DJ.STOXX600.OIL(EUX) 09/23	EUR	1.201.215,00	17.885,00	CACEIS Bank, Parigi
-42,00	DJ.STOXX600.TLC(EUX) 09/23	EUR	413.847,00	-3.990,00	CACEIS Bank, Parigi
31,00	DJ.STOXX 600 AUTO 09/23	EUR	993.209,00	-2.435,00	CACEIS Bank, Parigi
-28,00	DJ.STOXX600 BASI 09/23	EUR	747.600,00	37.170,00	CACEIS Bank, Parigi
-19,00	DJ.STOXX600 CHEM 09/23	EUR	1.142.375,00	-25.800,00	CACEIS Bank, Parigi
11,00	DJ.STOXX 600 RETL 09/23	EUR	207.223,50	7.010,00	CACEIS Bank, Parigi
49,00	DJ.STOXX600 TRAVEL 09/23	EUR	610.368,50	595,00	CACEIS Bank, Parigi
41,00	DJ.STOXX600 UTI 09/23	EUR	800.853,00	5.125,00	CACEIS Bank, Parigi
17,00	DJ.STOXX LARGE 200 09/23	EUR	406.767,50	1.025,00	CACEIS Bank, Parigi
-23,00	DJ ESTOXX50D 12/24	EUR	272.895,00	-34.170,00	CACEIS Bank, Parigi
16,00	DJ ESTOXX50D 12/25	EUR	189.840,00	9.600,00	CACEIS Bank, Parigi
55,00	DJ ESTOXX50D 12/26	EUR	652.575,00	88.790,00	CACEIS Bank, Parigi
-116,00	DJ EURO STOXX 50 09/23	EUR	5.102.944,40	-80.370,00	CACEIS Bank, Parigi
26,00	DJ EURO STOXX 600 09/23	EUR	941.044,00	-2.550,00	CACEIS Bank, Parigi
2,00	DJIA MINI FUTURE-CBT 09/23	USD	315.376,72	641,61	CACEIS Bank, Parigi
-3,00	DJ ST600 HLTH (EUX) 09/23	EUR	157.909,50	-3.360,00	CACEIS Bank, Parigi
-10,00	DJ STOXX 600 FOOD 09/23	EUR	383.360,00	-2.005,00	CACEIS Bank, Parigi
-7,00	DJ STX 600 F S (EUX) 09/23	EUR	208.761,00	5.110,00	CACEIS Bank, Parigi
-77,00	DJ STX 600 REA (EUX) 09/23	EUR	402.248,00	23.870,00	CACEIS Bank, Parigi
-13,00	EMINI CONS STA IDX 09/23	USD	891.971,59	-9.023,83	CACEIS Bank, Parigi
8,00	E-MINI CONSUMER-CME 09/23	USD	1.258.830,43	60.108,16	CACEIS Bank, Parigi
-11,00	EMINI ENERGY SE INDX 09/23	USD	861.407,88	-730,52	CACEIS Bank, Parigi
-5,00	EMINI FIN SECT IDX 09/23	USD	476.535,29	-8.822,18	CACEIS Bank, Parigi
3,00	EMINI HEALTH CA INDX 09/23	USD	369.236,48	8.001,83	CACEIS Bank, Parigi
15,00	E-MINI INDUSTRIAL SE 09/23	USD	1.487.832,26	57.679,19	CACEIS Bank, Parigi
-7,00	EMINI MATERIALS INDX 09/23	USD	564.087,08	-23.409,72	CACEIS Bank, Parigi
5,00	EMINI REG BANK 50 09/23	USD	294.422,55	-21.223,65	CACEIS Bank, Parigi
-9,00	E-MINI RUS 1000 V 09/23	USD	641.647,20	-14.560,04	CACEIS Bank, Parigi
5,00	E-MINI RUSS 1000 GRW 09/23	USD	634.799,50	22.639,78	CACEIS Bank, Parigi
-20,00	EMINI S&P REAL ESTAT 09/23	USD	848.716,77	-21.264,89	CACEIS Bank, Parigi
-5,00	E-MINI TECHNOLO-CME 09/23	USD	803.308,89	-36.040,33	CACEIS Bank, Parigi
1,00	E-MINU UTL S .SECT 09/23	USD	60.819,43	-247,48	CACEIS Bank, Parigi
13,00	EM RUSS 2000 09/23	USD	1.125.276,90	325,39	CACEIS Bank, Parigi
109,00	EURO STOX BANK IDX 09/23	EUR	585.057,50	-720,00	CACEIS Bank, Parigi
-12,00	EUX MSCI INDO 09/23	USD	202.653,71	-503,76	CACEIS Bank, Parigi
-49,00	EUX STX SMALL 200 ID 09/23	EUR	756.878,50	13.720,00	CACEIS Bank, Parigi
-12,00	FTSE/JSE TOP40 09/23	ZAR	411.669,69	7.433,06	CACEIS Bank, Parigi
-103,00	FTSE/XINHUA CHIN-SGX 07/23	USD	1.179.113,98	662,19	CACEIS Bank, Parigi
32,00	FTSE 100 INDEX 09/23	GBP	2.808.471,25	6.071,20	CACEIS Bank, Parigi
-9,00	FTSE 250 Y2 09/23	GBP	386.298,06	-10.022,72	CACEIS Bank, Parigi
7,00	FTSE MIB INDEX 09/23	EUR	988.079,05	4.390,00	CACEIS Bank, Parigi
30,00	FTSE TAIWAN 07/23	USD	1.602.236,48	274,98	CACEIS Bank, Parigi
-10,00	HANG SENG INDEX 07/23	HKD	1.106.262,79	15.790,03	CACEIS Bank, Parigi
-13,00	H-SHARES IDX (HKG) 07/23	HKD	488.458,31	6.345,25	CACEIS Bank, Parigi
11,00	IBEX 35 INDEX 07/23	EUR	1.055.230,00	18.180,80	CACEIS Bank, Parigi



# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Futures finanziari

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Quantità Acquisto/ (Vendita)	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Guadagno/ (perdita) non realizzato/a (in EUR)	Broker
44,00	MINI MSCI EMG MKT 09/23	USD	1.995.275,18	-28.848,76	CACEIS Bank, Parigi
-20,00	MSCI.SING INDEX 07/23	SGD	390.585,84	-1.659,33	CACEIS Bank, Parigi
9,00	MSCI BRAZIL IX FU 09/23	USD	459.744,09	10.634,19	CACEIS Bank, Parigi
6,00	MSCI India Net Total 09/23	USD	537.272,23	20.821,26	CACEIS Bank, Parigi
-12,00	MSCI MEXICO IDX 09/23	USD	396.022,00	4.935,84	CACEIS Bank, Parigi
15,00	NASDAQ 100 E-MINI 09/23	USD	4.173.934,92	115.959,67	CACEIS Bank, Parigi
40,00	NIKKEI 225 (SGX) 09/23	JPY	4.209.464,66	47.649,56	CACEIS Bank, Parigi
86,00	OMXS30 INDEX (OML) 07/23	SEK	1.685.739,39	448,31	CACEIS Bank, Parigi
-3,00	S&P/TSE CAN 60 INDEX 09/23	CAD	506.448,71	-14.975,41	CACEIS Bank, Parigi
27,00	S&P 500 EMINI INDEX 09/23	USD	5.506.886,34	120.178,74	CACEIS Bank, Parigi
8,00	S&P EMINI RETAIL CME 09/23	USD	494.019,43	14.878,09	CACEIS Bank, Parigi
3,00	SP EMINI BIOTECH 09/23	USD	122.375,25	-14.216,32	CACEIS Bank, Parigi
16,00	SP EMINICME 09/23	USD	1.249.385,88	28.304,31	CACEIS Bank, Parigi
-16,00	SPI 200 INDEX (SFE) 09/23	AUD	1.757.974,13	-12.965,22	CACEIS Bank, Parigi
-93,00	STOXX EUR 600 09/23	EUR	2.147.974,50	-4.795,00	CACEIS Bank, Parigi
-12,00	SWISS MARKET INDEX 09/23	CHF	1.386.849,85	-1.936,38	CACEIS Bank, Parigi
-3,00	TOPIX (OSE) 09/23	JPY	435.404,92	-8.583,42	CACEIS Bank, Parigi
50,00	WIG20 INDEX FUT 09/23	PLN	464.819,01	-943,00	CACEIS Bank, Parigi
<b>Futures su obbligazioni</b>					
101,00	AUSTR 10YR BOND 09/23	AUD	5.076.128,13	-29.530,84	CACEIS Bank, Parigi
-139,00	AUSTR 3YR BOND 09/23	AUD	7.589.705,31	35.462,94	CACEIS Bank, Parigi
67,00	CAN 10YR BOND (MSE) 09/23	CAD	4.022.552,47	14.061,09	CACEIS Bank, Parigi
124,00	EURO BOBL FUTURE 09/23	EUR	12.190.130,00	-199.730,00	CACEIS Bank, Parigi
34,00	EURO BTP FUTURE -EUX 09/23	EUR	3.517.776,00	-15.330,00	CACEIS Bank, Parigi
10,00	EURO BUND FUTURE 09/23	EUR	946.260,00	-3.690,00	CACEIS Bank, Parigi
7,00	EURO BUXL FUTURE 09/23	EUR	556.741,50	8.860,00	CACEIS Bank, Parigi
-21,00	EURO-OAT-FUTURES-EUX 09/23	EUR	2.112.652,50	20.220,00	CACEIS Bank, Parigi
131,00	EURO SCHATZ 09/23	EUR	13.004.239,00	-94.275,00	CACEIS Bank, Parigi
-11,00	JPN 10 YEARS BOND 09/23	JPY	6.921.472,00	-48.133,11	CACEIS Bank, Parigi
17,00	LONG GILT FUTURE-LIF 09/23	GBP	1.282.473,34	-12.328,85	CACEIS Bank, Parigi
31,00	SHORT EUR-BTP 09/23	EUR	3.015.075,50	-14.790,00	CACEIS Bank, Parigi
-107,00	US 10 YEARS NOTE 09/23	USD	9.654.273,60	77.287,18	CACEIS Bank, Parigi
3,00	US 10YR ULTRA (CBOT) 09/23	USD	267.243,35	-2.291,48	CACEIS Bank, Parigi
94,00	US 2 YEARS NOTE- CBT 09/23	USD	17.143.045,37	-201.019,71	CACEIS Bank, Parigi
255,00	US 5 YEARS NOTE- CBT 09/23	USD	23.015.152,38	-358.508,53	CACEIS Bank, Parigi
12,00	US TREASURY BOND 09/23	USD	1.180.940,66	-9.051,33	CACEIS Bank, Parigi
50,00	US ULTRA BD CBT 30YR 09/23	USD	4.131.101,05	55.081,35	CACEIS Bank, Parigi
				<b>-451.437,35</b>	

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Quantità Acquisto/ (Vendita)	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Guadagno/ (perdita) non realizzato/a (in EUR)	Broker
<b>Futures su indice</b>					
-495,00	DJ EURO STOXX 50 09/23	EUR	21.775.495,50	-280.850,00	CACEIS Bank, Parigi
139,00	FTSE/XINHUA CHIN-SGX 07/23	USD	1.591.231,48	-1.275,86	CACEIS Bank, Parigi
-66,00	FTSE 100 INDEX 09/23	GBP	5.800.139,84	61.067,41	CACEIS Bank, Parigi
43,00	H-SHARES IDX (HKG) 07/23	HKD	1.615.669,79	-20.994,89	CACEIS Bank, Parigi
68,00	MSCI EM NTR INDEX 09/23	EUR	2.983.296,00	-65.484,00	CACEIS Bank, Parigi
36,00	NASDAQ 100 E-MINI 09/23	USD	10.017.443,81	395.349,22	CACEIS Bank, Parigi
21,00	NIKKEI 225 (OSAKA) 09/23	JPY	4.419.937,89	105.807,24	CACEIS Bank, Parigi
181,00	S&P 500 EMINI INDEX 09/23	USD	36.916.534,37	1.090.009,17	CACEIS Bank, Parigi
17,00	SPI 200 INDEX (SFE) 09/23	AUD	1.867.847,52	23.428,92	CACEIS Bank, Parigi

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Futures finanziari

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Quantità Acquisto/ (Vendita)	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Guadagno/ (perdita) non realizzato/a (in EUR)	Broker
-39,00	SWISS MARKET INDEX 09/23	CHF	4.507.262,03	14.712,36	CACEIS Bank, Parigi
21,00	TOPIX (OSE) 09/23	JPY	3.047.834,42	81.702,63	CACEIS Bank, Parigi
<b>Futures su obbligazioni</b>					
46,00	AUSTR 10YR BOND 09/23	AUD	2.311.899,94	-22.097,58	CACEIS Bank, Parigi
322,00	CAN 10YR BOND (MSE) 09/23	CAD	19.332.267,09	-174.669,25	CACEIS Bank, Parigi
-371,00	EURO BOBL FUTURE 09/23	EUR	36.472.082,50	686.350,00	CACEIS Bank, Parigi
157,00	EURO BTP FUTURE -EUX 09/23	EUR	16.243.848,00	78.500,00	CACEIS Bank, Parigi
54,00	EURO BUND FUTURE 09/23	EUR	5.109.804,00	-44.940,00	CACEIS Bank, Parigi
-100,00	EURO BUXL FUTURE 09/23	EUR	7.953.450,00	-226.140,00	CACEIS Bank, Parigi
10,00	EURO SCHATZ 09/23	EUR	992.690,00	-200,00	CACEIS Bank, Parigi
-11,00	JPN 10 YEARS BOND 09/23	JPY	6.921.472,00	-48.133,11	CACEIS Bank, Parigi
74,00	LONG GILT FUTURE-LIF 09/23	GBP	5.582.531,03	-59.686,53	CACEIS Bank, Parigi
-263,00	US 10YR ULTRA (CBOT) 09/23	USD	23.428.334,10	222.874,66	CACEIS Bank, Parigi
1.729,00	US 2 YEARS NOTE- CBT 09/23	USD	315.322.611,14	-3.453.561,81	CACEIS Bank, Parigi
-46,00	US 5 YEARS NOTE- CBT 09/23	USD	4.151.752,98	35.403,30	CACEIS Bank, Parigi
133,00	US TREASURY BOND 09/23	USD	13.088.758,94	89.152,73	CACEIS Bank, Parigi
				<b>-1.513.675,39</b>	

#### onemarkets Fund - onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

Quantità Acquisto/ (Vendita)	Denominazione	Valuta	Impegno (in EUR) (in valore assoluto)	Guadagno/(p erdita) non realizzato/a (in EUR)	Broker
<b>Futures su indice</b>					
-32,00	FTSE 100 INDEX 09/23	GBP	2.812.189,01	29.738,39	BofA Securities Europe SA
5,00	S&P/TSE CAN 60 INDEX 09/23	CAD	841.243,33	15.156,89	BofA Securities Europe SA
1,00	S&P 500 EMINI INDEX 09/23	USD	203.958,75	3.528,87	BofA Securities Europe SA
				<b>48.424,15</b>	

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Credit Default Swaps ("CDS")

Al 30 giugno 2023 erano in essere i seguenti Credit Default Swap ("CDS"):

#### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Descrizione/Sottostante	Controparte	Nozionale	Scadenza	Valuta	Acquisto / Vendita	Non realizzato (in EUR)
<b>CDS Index</b>						
CDX HY CDSI S40 5Y PRC Corp	BNP Paribas Parigi	300.000	20/06/28	USD	Vendita	7.562,54
ITRX EUR CDSI S38 5Y Corp	BNP Paribas Parigi	3.000.000	20/12/27	EUR	Acquisto	-39.343,69
ITRX EUR CDSI S38 5Y Corp	BNP Paribas Parigi	5.000.000	20/12/27	EUR	Vendita	65.572,81
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	BNP Paribas Parigi	700.000	20/12/27	EUR	Acquisto	-34.140,98
ITRX XOVER CDSI S39	BNP Paribas Parigi	1.980.000	20/12/27	USD	Vendita	56.703,96
MARKIT CDX NA IG 40 5Y 06/2028	BNP Paribas Parigi	100.000	20/06/28	USD	Vendita	1.369,99
CDX HY CDSI S39 5Y PRC Corp	BOFA Securities Europe	198.000	20/12/27	USD	Acquisto	-5.670,39
CDX HY CDSI S40 5Y PRC Corp	BOFA Securities Europe	100.000	20/06/28	USD	Vendita	2.520,85
CDX IG CDSI S39 5Y Corp	BOFA Securities Europe	5.000.000	20/12/27	USD	Vendita	66.466,57
ITRX EUR CDSI S38 5Y Corp	BOFA Securities Europe	200.000	20/12/27	EUR	Vendita	2.622,91
ITRX EUR CDSI S39 5Y	BOFA Securities Europe	2.200.000	20/06/28	EUR	Vendita	25.955,99
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	BOFA Securities Europe	2.500.000	20/12/27	EUR	Vendita	121.932,07
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	BOFA Securities Europe	200.000	20/12/27	EUR	Vendita	9.754,56
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	BOFA Securities Europe	4.000.000	20/12/27	EUR	Vendita	195.091,31
MARKIT CDX NA IG 40 5Y 06/2028	BOFA Securities Europe	3.600.000	20/06/28	USD	Vendita	49.319,86
SNRFIN CDSI S38 5Y	BOFA Securities Europe	1.500.000	20/12/27	EUR	Acquisto	-12.990,84
ITRX EUR CDSI S39 5Y	Citigroup Global Markets Europe AG	800.000	20/06/28	EUR	Vendita	9.438,54
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	Citigroup Global Markets Europe AG	400.000	20/12/27	EUR	Vendita	19.509,13
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	Citigroup Global Markets Europe AG	300.000	20/12/27	EUR	Vendita	14.631,85
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	Goldman Sachs Bank Europe SE	200.000	20/12/27	EUR	Vendita	9.754,56
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	Goldman Sachs Bank Europe SE	2.970.000	20/12/27	USD	Vendita	85.055,94
ITRX XOVER CDSI S39	Goldman Sachs Bank Europe SE	600.000	20/06/28	EUR	Vendita	23.782,18
ITRX XOVER CDSI S39	J.P. Morgan AG	200.000	20/06/28	EUR	Vendita	7.927,39
ITRX XOVER CDSI S38 5Y Corp	Morgan Stanley Bk AG	5.600.000	20/06/28	USD	Vendita	-249.045,32
<b>CDS Single Name</b>						
COLOMBIA 10.375 03-33 28/01S	BNP Paribas Parigi	600.000	20/06/28	USD	Acquisto	31.460,30
BNP PARIBAS 2.25 16-27 11/01A	Goldman Sachs Bank Europe SE	300.000	20/06/28	EUR	Acquisto	4.465,13
COMMERZBANK AG 1.00 19-26 25/02A	Goldman Sachs Bank Europe SE	300.000	20/06/28	EUR	Vendita	1.994,25
HANNOVER RUECK SE 1.125 18-28 18/04A	Goldman Sachs Bank Europe SE	300.000	20/06/28	EUR	Acquisto	-7.837,46
LINDT SPRUE	Goldman Sachs Bank Europe SE	300.000	20/06/28	EUR	Vendita	-773,31
MEDIOBANCA 2.3000 20-30 23/11A	Goldman Sachs Bank Europe SE	400.000	20/06/28	EUR	Acquisto	16.281,83
SOCIETE GENERALE S FL.R 16-28 20/07A	Goldman Sachs Bank Europe SE	400.000	20/06/28	EUR	Vendita	-12.346,40
BARCLAYS BANK PLC 2.25 14-24 10/06A	J.P. Morgan AG	800.000	20/06/24	EUR	Vendita	603,39
BARCLAYS BANK PLC 2.25 14-24 10/06A	J.P. Morgan AG	800.000	20/06/24	EUR	Vendita	3.635,10
BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A	J.P. Morgan AG	200.000	20/06/28	EUR	Acquisto	1.538,40
BARCLAYS PLC 1.375 18-26 24/01A	J.P. Morgan AG	200.000	20/06/28	EUR	Acquisto	-2.084,63
BRAZIL 4.25 13-25 07/01S	J.P. Morgan AG	900.000	20/06/28	USD	Acquisto	26.954,71
PERU 8.75 03-33 21/11S	J.P. Morgan AG	900.000	20/06/28	USD	Acquisto	-8.566,99
MEXICO 4.15 17-27 28/03S	Morgan Stanley Bk AG	2.200.000	20/06/28	USD	Acquisto	2.716,51
SOUTH AFRICA 5.875 13-25 16/09S	Morgan Stanley Bk AG	800.000	20/06/28	USD	Acquisto	51.485,66
						<b>543.308,28</b>

## onemarkets Fund

### Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

#### Credit Default Swaps ("CDS")

##### onemarkets Fund - onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Descrizione/Sottostante	Controparte	Nozionale	Scadenza	Valuta	Acquisto /Vendita	Non realizzato (in EUR)
<b>CDS Index</b>						
ITRX EUR CDSI S39 5Y	BOFA Securities Europe	6.500.000	20/06/28	EUR	Vendita	76.688,13
ITRX EUR CDSI S39 5Y	BOFA Securities Europe	2.200.000	20/06/28	EUR	Vendita	25.955,99
ITRX EUR CDSI S39 5Y	BOFA Securities Europe	15.900.000	20/06/28	EUR	Vendita	187.590,98
ITRX EUR CDSI S39 5Y	BOFA Securities Europe	7.500.000	20/06/28	EUR	Vendita	88.486,30
ITRX XOVER CDSI S39	BOFA Securities Europe	3.700.000	20/06/28	EUR	Vendita	146.656,79
ITRX XOVER CDSI S39	Goldman Sachs Bank Europe SE	8.500.000	20/06/28	EUR	Vendita	336.914,26
ITRX XOVER CDSI S39	Goldman Sachs Bank Europe SE	7.300.000	20/06/28	USD	Vendita	184.021,83
MARKIT CDX EM CDSI S39 5Y	Goldman Sachs Bank Europe SE	1.100.000	20/06/28	USD	Vendita	-48.919,62
MARKIT CDX NA IG 40 5Y 06/2028	Goldman Sachs Bank Europe SE	6.500.000	20/06/28	USD	Vendita	89.049,76
CDX HY CDSI S40 5Y PRC Corp	Morgan Stanley Bk AG	7.400.000	20/06/28	USD	Vendita	186.542,68
MARKIT CDX EM CDSI S39 5Y	Morgan Stanley Bk AG	2.200.000	20/06/28	USD	Vendita	-97.839,23
MARKIT CDX NA IG 40 5Y 06/2028	Morgan Stanley Bk AG	22.400.000	20/06/28	USD	Vendita	306.879,16
						<b>1.482.027,03</b>

##### onemarkets Fund - onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

Descrizione/Sottostante	Controparte	Nozionale	Scadenza	Valuta	Acquisto /Vendita	Non realizzato (in EUR)
<b>CDS Index</b>						
CDX HY CDSI S40 5Y PRC Corp	BARCLAYS CAPITAL	700.000	20/06/28	USD	Vendita	17.645,93
CDX IG CDSI S39 5Y Corp	BARCLAYS CAPITAL	2.700.000	20/12/27	USD	Vendita	35.891,95
ITRX EUR CDSI S39 5Y	BARCLAYS CAPITAL	3.500.000	20/06/28	EUR	Vendita	41.293,61
ITRX XOVER CDSI S39	BARCLAYS CAPITAL	200.000	20/06/28	EUR	Vendita	7.927,39
MARKIT CDX NA IG 40 5Y 06/2028	BARCLAYS CAPITAL	35.780.000	20/06/28	USD	Vendita	490.184,65
						<b>592.943,53</b>

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Swap su tassi di interesse ("IRS")

Al 30 giugno 2023 erano in essere i seguenti swap su tassi di interesse ("IRS"):

#### onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Nominale	Valuta	Scadenza	Controparte	Il Comparto ha pagato	Il Comparto ha ricevuto	Non realizzato (in EUR)
4.200.000	CHF	27/12/24	Goldman Sachs Bank Europe SE	CHF Overnight Compounded Rate	1,525%	28.073,55
2.900.000	CHF	27/12/27	Goldman Sachs Bank Europe SE	1,725%	CHF Overnight Compounded Rate	-11.497,24
600.000	CHF	27/12/32	Goldman Sachs Bank Europe SE	CHF Overnight Compounded Rate	1,94%	-10.417,20
405.000.000	JPY	12/01/28	Citigroup Global Markets Europe	0,51625%	JPY Overnight Compounded Rate	33.819,82
85.000.000	JPY	12/01/33	Citigroup Global Markets Europe	JPY Overnight Compounded Rate	0,88%	-15.679,24
600.000.000	JPY	12/01/25	Citigroup Global Markets Europe	JPY Overnight Compounded Rate	0,2338%	-11.726,57
90.000.000	JPY	26/01/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	0,805%	JPY Overnight Compounded Rate	12.521,72
90.000.000	JPY	27/01/33	Morgan Stanley Bank AG	0,818%	JPY Overnight Compounded Rate	13.213,80
90.000.000	JPY	30/01/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	0,838%	JPY Overnight Compounded Rate	14.271,48
1.000.000	GBP	01/02/33	BofA Securities Europe SA	GBP Overnight Compounded Rate	3,38736%	89.348,73
1.900.000	GBP	01/02/28	BofA Securities Europe SA	3,62486%	GBP Overnight Compounded Rate	-138.946,95
1.000.000	GBP	02/02/33	BofA Securities Europe SA	GBP Overnight Compounded Rate	3,37%	90.874,11
1.900.000	GBP	02/02/28	BofA Securities Europe SA	3,6%	GBP Overnight Compounded Rate	-141.134,08
1.900.000	GBP	03/02/28	BofA Securities Europe SA	3,58%	GBP Overnight Compounded Rate	-142.906,40
1.000.000	GBP	03/02/33	BofA Securities Europe SA	GBP Overnight Compounded Rate	3,3595%	91.802,08
1.900.000	GBP	06/02/28	Citigroup Global Markets Europe	3,49%	GBP Overnight Compounded Rate	-150.846,06
500.000	GBP	06/02/33	Citigroup Global Markets Europe	GBP Overnight Compounded Rate	3,29%	48.959,21
3.100.000	CHF	10/03/26	Goldman Sachs Bank Europe SE	CHF Overnight Compounded Rate	2,055%	-13.220,31
1.000.000	EUR	13/03/33	JP Morgan AG Francoforte	Euro Short Term Rate Compounded	2,9975%	15.658,39
3.000.000	EUR	13/03/26	JP Morgan AG Francoforte	Euro Short Term Rate Compounded	3,485%	-5.301,68
204.800.000	JPY	27/03/28	Citigroup Global Markets Europe	JPY Overnight Compounded Rate	0,274%	2.273,43
110.300.000	JPY	27/03/33	Citigroup Global Markets Europe	JPY Overnight Compounded Rate	0,618%	-2.452,99
80.000.000	JPY	30/03/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	0,647%	JPY Overnight Compounded Rate	3.163,45
80.000.000	JPY	31/03/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	0,625%	JPY Overnight Compounded Rate	2.089,63
80.000.000	JPY	03/04/33	Citigroup Global Markets Europe	0,63%	JPY Overnight Compounded Rate	2.309,32
2.400.000	CHF	04/04/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	1,9225%	CHF Overnight Compounded Rate	38.912,45
80.000.000	JPY	05/04/33	Citigroup Global Markets Europe	0,6575%	JPY Overnight Compounded Rate	3.630,74
3.800.000	EUR	06/04/28	Citigroup Global Markets Europe	Euro Short Term Rate Compounded	2,791%	41.835,00
63.300.000	JPY	10/04/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	JPY Overnight Compounded Rate	0,676%	-3.556,93
23.800.000	JPY	10/04/53	Goldman Sachs Bank Europe SE	1,101%	JPY Overnight Compounded Rate	1.733,26
800.000	EUR	03/05/53	Goldman Sachs Bank Europe SE	Euro Short Term Rate Compounded	2,5395%	-10.659,96
2.000.000	EUR	03/05/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,8025%	Euro Short Term Rate Compounded	-1.356,31

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Swap su tassi di interesse ("IRS")

onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Nominale	Valuta	Scadenza	Controparte	Il Comparto ha pagato	Il Comparto ha ricevuto	Non realizzato (in EUR)
800.000	EUR	09/05/53	Citigroup Global Markets Europe	Euro Short Term Rate Compounded	2,552% Euro Short Term Rate Compounded	-12.778,08
1.900.000	EUR	09/05/33	Citigroup Global Markets Europe	2,737%	Euro Short Term Rate Compounded	-11.904,11
4.900.000	EUR	17/05/29	Citigroup Global Markets Europe	2,507%	Euro Short Term Rate Compounded	5.667,99
1.100.000	EUR	17/05/37	Citigroup Global Markets Europe	Euro Short Term Rate Compounded	2,827% GBP Overnight Compounded Rate	-16.537,59
1.900.000	GBP	23/05/25	BofA Securities Europe SA	4,633%	GBP Overnight Compounded Rate	-52.038,99
400.000	CHF	25/05/33	BNP Paribas SA Paris	CHF Overnight Compounded Rate	1,9552%	-7.789,35
2.500.000	CHF	12/06/28	BNP Paribas SA Paris	CHF Overnight Compounded Rate	1,8682% GBP Overnight Compounded Rate	-8.853,60
1.800.000	GBP	13/06/25	Citigroup Global Markets Europe	5,175%	GBP Overnight Compounded Rate	-30.224,11
300.000.000	JPY	13/06/25	BofA Securities Europe SA	JPY Overnight Compounded Rate	0,08%	-367,84
3.000.000	CHF	13/06/28	Morgan Stanley Bank AG	CHF Overnight Compounded Rate	1,8947% GBP Overnight Compounded Rate	-14.526,68
1.000.000	GBP	12/06/33	BNP Paribas SA Paris	3,728%	GBP Overnight Compounded Rate	9.879,85
1.000.000	EUR	12/06/33	BNP Paribas SA Paris	Euro Short Term Rate Compounded	2,7077%	-5.409,27
1.700.000	EUR	20/06/38	Goldman Sachs Bank Europe SE	Euro Short Term Rate Compounded	2,976% Euro Short Term Rate Compounded	-11.359,51
4.100.000	EUR	20/06/35	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,97%	GBP Overnight Compounded Rate	9.879,50
2.000.000	GBP	19/06/26	Goldman Sachs Bank Europe SE	5,285%	GBP Overnight Compounded Rate	-7.573,73
70.000.000	JPY	21/06/43	Citigroup Global Markets Europe	JPY Overnight Compounded Rate	1,34375%	2.237,14
500.000	EUR	22/06/43	BofA Securities Europe SA	2,754%	Euro Short Term Rate Compounded	3.431,27
1.400.000	EUR	29/06/35	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,57%	Euro Short Term Rate Compounded	-5.715,32
1.400.000	EUR	29/06/30	Goldman Sachs Bank Europe SE	Euro Short Term Rate Compounded	2,471%	4.312,23
400.000	EUR	29/06/45	Goldman Sachs Bank Europe SE	Euro Short Term Rate Compounded	2,522%	120,63
1.500.000	EUR	03/07/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,5428%	Euro Short Term Rate Compounded	-2.135,97
500.000	CHF	03/07/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	1,7378%	CHF Overnight Compounded Rate	-422,58
9.000.000	NZD	02/12/27	Goldman Sachs Bank Europe SE	4,4975%	NZD BBR 3 Mesi	-55.656,18
3.000.000	NZD	02/12/32	Goldman Sachs Bank Europe SE	4,335%	NZD BBR 3 Mesi	-22.645,17
4.400.000	CAD	23/12/27	Goldman Sachs Bank Europe SE	4,335%	CAD CDOR 3 mesi	97.197,15
6.400.000	CAD	23/12/24	Goldman Sachs Bank Europe SE	4,175%	CAD CDOR 3 mesi	-63.285,71
1.000.000	CAD	23/12/32	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,4675%	CAD CDOR 3 mesi	-18.203,51
4.000.000.000	KRW	27/12/27	Morgan Stanley Bank AG	3,36%	KRW Certif Deposit 3 mesi	-19.309,40
6.100.000	PLN	28/12/27	Citigroup Global Markets Europe	6,07%	PLN WIBOR 6 Mesi	54.362,93
16.000.000	CZK	28/12/27	Citigroup Global Markets Europe	4,93%	CZK Pribor 6 mesi	8.436,70
20.000.000	MXN	17/12/27	Goldman Sachs Bank Europe SE	8,49%	MXN TIIE 28D	1.640,11
3.400.000	ILS	28/12/27	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,44%	ILS TELBOR 3 mesi	-10.395,73
34.500.000	ZAR	28/12/27	Goldman Sachs Bank Europe SE	8,15%	ZAR JIBAR 3 Mesi	-29.426,87
700.000	USD	11/01/33	JP Morgan AG Francoforte	3,17%	USD SOFR Compounded	-22.167,31
3.400.000	USD	11/01/28	JP Morgan AG Francoforte	USD SOFR Compounded	3,37%	84.578,66
4.800.000	USD	11/01/25	JP Morgan AG Francoforte	4,216%	USD SOFR Compounded	-57.102,15
100.000.000	INR	17/01/28	Goldman Sachs Bank Europe SE	6,275%	INR OIS Overnight Compounded	-8.052,67
3.700.000	CAD	18/01/25	Goldman Sachs Bank Europe SE	4,09375%	CAD CDOR 3 mesi	-40.841,50

# onemarkets Fund

## Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

### Swap su tassi di interesse ("IRS")

onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Nominale	Valuta	Scadenza	Controparte	Il Comparto ha pagato	Il Comparto ha ricevuto	Non realizzato (in EUR)
1.700.000	AUD	20/01/28	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,6275%	AUD BANK BILL 6 mesi	-29.410,88
27.000.000	NOK	23/01/25	JP Morgan AG Francoforte	3,224%	NOK OIBOR 6 mesi	-55.597,90
3.700.000	CAD	19/01/25	JP Morgan AG Francoforte	4%	CAD CDOR 3 mesi	-45.089,74
8.000.000	SEK	26/01/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	SEK STIBOR 3 mesi	2,705%	21.134,48
8.000.000	SEK	27/01/33	Citigroup Global Markets Europe	SEK STIBOR 3 mesi	2,63%	25.216,23
18.000.000	NOK	31/01/26	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,135%	NOK OIBOR 6 mesi	-56.205,39
600.000	NZD	02/02/43	Morgan Stanley Bank AG	4,2525%	NZD BBR 3 Mesi	-17.017,87
19.000.000	NOK	07/02/26	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,0025%	NOK OIBOR 6 mesi	-64.507,76
66.000.000	SEK	13/02/26	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,0025%	SEK STIBOR 3 mesi	-119.327,61
8.000.000	CAD	13/02/25	Goldman Sachs Bank Europe SE	4,505%	CAD CDOR 3 mesi	-55.046,83
50.000.000	SEK	07/03/28	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,436%	SEK STIBOR 3 mesi	240,76
1.500.000	CAD	07/03/33	Citigroup Global Markets Europe	3,706%	CAD CDOR 3 mesi	-6.978,05
500.000	USD	10/03/53	Citigroup Global Markets Europe	3,155%	USD SOFR Compounded	-4.383,88
3.400.000	USD	10/03/26	Citigroup Global Markets Europe	Compounded	4,615%	-5.497,84
1.800.000	NZD	30/03/33	Citigroup Global Markets Europe	4,212%	NZD BBR 3 Mesi	-23.229,33
12.500.000	NOK	04/04/43	Goldman Sachs Bank Europe SE	NOK OIBOR 6 mesi	2,87%	96.619,32
5.000.000	NZD	05/04/30	Goldman Sachs Bank Europe SE	NZD BBR 3 Mesi	4,2775%	47.153,45
8.000.000.000	KRW	18/04/25	BNP Paribas SA Paris	3,08%	KRW Certif Deposit 3 mesi	-30.481,63
15.000.000	TWD	18/01/28	BNP Paribas SA Paris	1,202%	TWD TAIBOR 3 mesi	-4.386,49
20.000.000	THB	27/01/28	Morgan Stanley Bank AG	1,99%	THB OIS	-11.865,46
8.000.000	CNY	09/05/28	Citigroup Global Markets Europe	2,688%	CNY SWAP HKSH 7D	15.074,23
800.000	SGD	11/05/28	Citigroup Global Markets Europe	2,705%	DEPO SGD OIS	-14.828,94
1.200.000	USD	15/05/36	BofA Securities Europe SA	USD SOFR Compounded	3,0895%	10.195,38
5.300.000	USD	15/05/28	BofA Securities Europe SA	2,715%	USD SOFR Compounded	-40.243,18
800.000	SGD	16/05/28	Morgan Stanley Bank AG	2,63%	SGD OIS	-16.652,05
5.000.000	CNY	16/05/28	Morgan Stanley Bank AG	2,5845%	CNY SWAP HKSH 7D	6.402,01
6.000.000	NOK	19/05/36	Goldman Sachs Bank Europe SE	NOK OIBOR 6 mesi	DEPO	10.324,40
28.000.000	NOK	19/05/28	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,195%	3,189%	10.324,40
28.000.000	SEK	24/05/29	Morgan Stanley Bank AG	2,5025%	NOK OIBOR 6 mesi	-19.208,01
6.000.000	SEK	24/05/37	Morgan Stanley Bank AG	SEK STIBOR 3 mesi	SEK STIBOR 3 mesi	-7.926,53
2.500.000	USD	30/05/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,69%	2,69%	2.823,40
2.300.000	USD	13/06/25	Goldman Sachs Bank Europe SE	USD SOFR Compounded	3,525%	12.100,40
8.000.000	CNY	13/06/28	Citigroup Global Markets Europe	2,433%	4,44%	16.225,74
35.000.000	CZK	16/06/28	JP Morgan AG Francoforte	4,405%	CNY SWAP HKSH 7D	2.912,64
700.000	USD	16/06/55	Goldman Sachs Bank Europe SE	USD SOFR Compounded	DEPO	2.912,64
3.100.000	USD	16/06/30	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,16%	CZK PRIBOR 6 mesi	-5.730,10
2.000.000	USD	21/06/29	BofA Securities Europe SA	USD SOFR Compounded	3,031%	-5.915,38
400.000	USD	21/06/54	BofA Securities Europe SA	USD SOFR Compounded	USD SOFR Compounded	-9.794,47
2.000.000	USD	21/06/34	BofA Securities Europe SA	3,26%	3,28%	16.307,95
30.000.000	SEK	24/06/32	Goldman Sachs Bank Europe SE	SEK STIBOR 3 mesi	3,07%	-480,08
7.000.000	CNY	21/06/28	BNP Paribas SA Paris	2,475%	USD SOFR Compounded	-13.520,36
					2,83%	-4.515,63
					CNY SWAP HKSH 7D	4.207,73
					DEPO	

## onemarkets Fund

### Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

#### Swap su tassi di interesse ("IRS")

##### onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Nominale	Valuta	Scadenza	Controparte	Il Comparto ha pagato	Il Comparto ha ricevuto	Non realizzato (in EUR)
1.500.000	PLN	23/06/33	Morgan Stanley Bank AG	5,175%	PLN WIBOR 6 Mesi	3.934,10
390.000.000	KRW	26/06/33	BofA Securities Europe SA	3,3455%	KRW Certif Deposit 3 mesi	-1.701,21
6.000.000	CNY	28/06/28	Citigroup Global Markets Europe	2,484%	CNY SWAP HKSH 7D DEPO	3.852,11
115.000.000	INR	30/06/28	Standard Chartered Bk Frankfurt	6,2425%	INR OIS Overnight Compounded	-5.812,71
11.800.000	SEK	03/07/33	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,641%	SEK STIBOR 3 mesi	-3.052,22
2.700.000	AUD	30/06/33	UBS Europe Se	4,395%	AUD BANK BILL 6 mesi	-6.684,43
						<b>-768.558,15</b>

##### onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Nominale	Valuta	Scadenza	Controparte	Il Comparto ha pagato	Il Comparto ha ricevuto	Non realizzato (in EUR)
2.800.000	GBP	19/04/33	BofA Securities Europe SA	GBP Overnight Compounded Rate	3,5825%	201.386,68
6.300.000	GBP	04/05/28	BofA Securities Europe SA	GBP Overnight Compounded Rate	4,024%	340.846,18
3.000.000	EUR	20/06/28	Morgan Stanley Bank AG	Euro Short Term Rate Compounded	2,98%	4.884,26
1.050.000	CAD	24/11/27	JP Morgan AG Francoforte	3,5765%	CAD CDOR 3 mesi	-19.211,44
250.000	CAD	24/11/52	JP Morgan AG Francoforte	3,375%	CAD CDOR 3 mesi	5.541,90
1.300.000	CAD	02/12/27	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,4675%	CAD CDOR 3 mesi	-27.595,78
200.000	CAD	02/12/52	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,28%	CAD CDOR 3 mesi	6.759,73
1.800.000	CAD	07/12/27	JP Morgan AG Francoforte	3,4%	CAD CDOR 3 mesi	-41.741,72
500.000	CAD	07/12/52	JP Morgan AG Francoforte	3,15%	CAD CDOR 3 mesi	24.949,50
13.000.000	NOK	12/12/32	Citigroup Global Markets Europe	3,056%	NOK OIBOR 6 mesi	-71.341,82
1.800.000	CAD	15/12/27	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,28%	CAD CDOR 3 mesi	-47.665,76
400.000	CAD	15/12/52	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,17%	CAD CDOR 3 mesi	18.962,20
450.000	CAD	27/01/53	Citigroup Global Markets Europe	3,31%	CAD CDOR 3 mesi	13.610,99
1.850.000	CAD	02/02/28	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,32%	CAD CDOR 3 mesi	-48.895,00
2.050.000	CAD	03/02/28	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,2%	CAD CDOR 3 mesi	-61.152,99
500.000	CAD	03/03/53	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,72375%	CAD CDOR 3 mesi	-10.852,11
27.000.000	SEK	14/03/33	JP Morgan AG Francoforte	3,075%	SEK STIBOR 3 mesi	-1.328,18
10.500.000	CAD	14/03/28	JP Morgan AG Francoforte	3,142%	CAD CDOR 3 mesi	-311.456,53
2.500.000	CAD	14/03/53	JP Morgan AG Francoforte	3,16%	CAD CDOR 3 mesi	119.139,93
28.150.000	NOK	23/05/33	JP Morgan AG Francoforte	3,535%	NOK OIBOR 6 mesi	-62.118,48
						<b>32.721,56</b>



## onemarkets Fund

### Nota integrativa - Prospetto degli strumenti finanziari derivati

#### Swap sull'inflazione ("IFS")

Al 30 giugno 2023 erano in essere i seguenti swap sull'inflazione ("IFS"):

#### onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Nominale	Valuta	Scadenza	Controparte	Il Comparto ha pagato	Il Comparto ha ricevuto	Non realizzato (in EUR)
500.000	EUR	15/12/2032	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,627%	CPTFEMU EURO EX TOBACCO	6.100,69
500.000	EUR	15/12/2032	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,605%	CPTFEMU EURO EX TOBACCO	7.107,89
500.000	EUR	15/12/2032	BofA Securities Europe SAc	2,574%	CPTFEMU EURO EX TOBACCO	8.523,64
500.000	EUR	15/01/2033	BofA Securities Europe SAc	2,299%	CPTFEMU EURO EX TOBACCO	14.962,67
3.000.000	USD	19/01/2033	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,39875%	CPTFEMU EURO EX TOBACCO	68.874,54
500.000	EUR	15/01/2033	BofA Securities Europe SAc	2,261%	CPURNSA URBAN CSUMER NSA	16.660,39
1.000.000	EUR	15/02/2033	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,285%	CPTFEMU EURO EX TOBACCO	28.123,87
1.000.000	USD	07/02/2033	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,475%	CPTFEMU EURO EX TOBACCO	16.498,12
3.500.000	GBP	15/02/2033	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,7425%	CPURNSA URBAN CSUMER NSA	223.901,37
1.000.000	EUR	15/02/2033	BofA Securities Europe SAc	2,4485%	UKRPI RETAIL PRICE	13.291,99
5.500.000	USD	08/03/2033	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,705%	CPTFEMU EURO EX TOBACCO	-13.219,25
4.000.000	GBP	15/03/2033	Goldman Sachs Bank Europe SE	3,715%	CPURNSA URBAN CSUMER NSA	235.302,31
4.000.000	EUR	15/03/2033	Goldman Sachs Bank Europe SE	2,394%	UKRPI RETAIL PRICE	83.016,78
						<b>709.145,01</b>

**onemarkets Fund**  
**Altre note al bilancio**

## Altre note al bilancio

### 1. Il Fondo

#### Informazioni

##### generali

onemarkets Fund (il "Fondo") è autorizzato in Lussemburgo come organismo di investimento collettivo in Valori Mobiliari ai sensi della Parte I della legge del 17 dicembre 2010 sugli organismi di investimento collettivo, e sue successive modifiche (la "Legge del 2010") e si qualifica come organismo di investimento collettivo in Valori Mobiliari ("OICVM") ai fini della Direttiva 2009/65/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 13 luglio 2009, concernente il coordinamento delle disposizioni legislative, regolamentari e amministrative in materia di organismi di investimento collettivo in Valori Mobiliari, e sue successive modifiche (la "Direttiva OICVM").

Il Fondo è un organismo di investimento collettivo in Valori Mobiliari di tipo aperto costituito nella forma giuridica di società di investimento a capitale variabile ("société d'investissement à capital variable" o "SICAV"), soggetto alla Parte I della Legge del 2010 che recepisce la Direttiva OICVM.

Il Fondo è stato costituito il 15 settembre 2022 come "société anonyme" a tempo indeterminato. Lo Statuto del Fondo è stato depositato presso il Registro del Commercio e delle Società del Lussemburgo ("RCS") e l'indicazione di tale deposito presso l'RCS è stata pubblicata nel RESA il 21 settembre 2022. Il Fondo è registrato presso l'RCS al numero B271238.

Lo Statuto del Fondo è stato modificato il 20 settembre 2022 con atto di rettifica e l'indicazione del deposito delle modifiche statutarie è stata pubblicata nel RESA il 21 settembre 2022. La versione legalmente vincolante dello Statuto è depositata presso l'RCS, dove può essere consultata e dove è possibile ottenerne una copia. Una copia dello Statuto del Fondo e delle relazioni e dei rendiconti finanziari più recenti è disponibile gratuitamente su richiesta presso la sede legale del Fondo durante il normale orario di lavoro.

Il Fondo ha nominato Structured Invest S.A. come società di gestione (la "Società di Gestione"). La valuta di riferimento consolidata del Fondo è l'euro.

L'esercizio finanziario del Fondo inizia il 1° luglio di ogni anno e termina il 30 giugno di ogni anno.

Il primo esercizio finanziario del Fondo è iniziato il 15 settembre 2022 (data di costituzione) ed è terminato il 30 giugno 2023.

Il Fondo è strutturato come un Fondo d'investimento multicomparto con l'obiettivo di fornire agli investitori una serie di Comparti (i "Comparti") con attività specifiche.

Al 30 giugno 2023 vengono offerti i seguenti Comparti:

- onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)
- onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)
- onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)
- onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)
- onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)
- onemarkets Pimco Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)
- onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)
- onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)
- onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)
- onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)
- onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund (lanciato il 30 giugno 2023)
- onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il 30 giugno 2023)
- onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund (lanciato il 30 giugno 2023)
- onemarkets Global Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno 2023)
- onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)
- onemarkets Multi-Asset Value Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

### 2. Principi contabili significativi

#### a. Informazioni generali

I bilanci del Fondo saranno redatti in conformità ai principi contabili generalmente riconosciuti in Lussemburgo.

#### b. Valutazione degli investimenti

Il valore delle attività di ogni Comparto è determinato in base ai seguenti principi:

- a. Le attività ufficialmente quotate in borsa sono valutate all'ultimo prezzo disponibile. Se un'attività è quotata su più borse, si applica il prezzo più recente disponibile sulla borsa valori che rappresenta il mercato principale per tale attività.

## **b. Valutazione degli investimenti**

- b.** Le attività non quotate in borsa, ma negoziate su un altro mercato regolamentato regolarmente funzionante, riconosciuto e aperto al pubblico, sono valutate a un prezzo che non può essere inferiore al prezzo bid (denaro) e non può essere superiore al prezzo ask (lettera) al momento della valutazione, e che la Società di Gestione considera il miglior prezzo possibile a cui le attività possono essere vendute.
- c.** Un'attività non quotata o negoziata in borsa o in un altro mercato regolamentato, o un'attività quotata o negoziata in borsa o in un altro mercato come sopra menzionato il cui prezzo indicato conformemente alle disposizioni di cui ai punti (a) o (b) di cui sopra non riflette ragionevolmente l'effettivo valore di mercato, sarà valutata all'effettivo valore di mercato dell'attività in questione, tale attività sarà valutata al valore di realizzo determinato in buona fede dalla Società di Gestione in applicazione di norme di valutazione generalmente riconosciute e verificabili dai revisori.
- d.** L'interesse pro rata sulle attività sarà incluso nella misura in cui non è espresso nel prezzo.
- e.** Il valore di liquidazione dei contratti a termine o delle opzioni non negoziati in borsa o su altri mercati organizzati sarà determinato in conformità alle direttive della Società di Gestione su una base che sarà applicata in modo coerente a tutti i diversi tipi di contratti. Il valore di liquidazione di futures, forward o opzioni negoziati in borsa o su altri mercati organizzati è calcolato sulla base degli ultimi prezzi di liquidazione disponibili per tali contratti nelle borse o nei mercati organizzati in cui tali futures, forward o opzioni sono negoziati dal Comparto. Se un future, un forward o un'opzione non possono essere regolati in un giorno per il quale ne viene determinato il Valore Patrimoniale Netto, la base di valutazione di tale contratto viene determinata dal gestore in modo opportuno e ragionevole.
- f.** Gli swap sono valutati al valore attuale.
- g.** La liquidità è valutata al valore nominale oltre agli interessi maturati pro rata. I depositi a tempo determinato possono essere valutati al rispettivo prezzo di rendimento, a condizione che un contratto corrispondente tra l'istituto finanziario che detiene i depositi e la Società di Gestione preveda che tali depositi possano essere richiamati in qualsiasi momento e che, in caso di richiamo, il valore di liquidazione corrisponda a tale prezzo di rendimento.
- h.** Le azioni o le quote di OICVM o di altri OIC sono valutate all'ultimo Valore Patrimoniale Netto (NAV) determinato e ottenibile. In caso di sospensione del rimborso per le quote d'investimento o se non sono stati fissati i prezzi di rimborso, tali quote ed eventuali altre attività sono valutate al valore di realizzo che la Società di Gestione determina in buona fede sulla base del probabile valore di realizzo.
- i.** Tutte le attività non denominate nella valuta del Comparto in questione sono convertite nella valuta del Comparto al tasso di cambio più recente disponibile. Gli utili o le perdite su operazioni in valuta estera sono indicati al netto.
- j.** Tutti gli altri titoli o altre attività sono valutati al loro adeguato valore di realizzo, determinato in buona fede dalla Società di Gestione e secondo una procedura specificata dalla stessa.

Le attività nette del Comparto sono ridotte a seguito di eventuali distribuzioni pagate agli Azionisti del Comparto in questione.

In caso di creazione di Classi di Azioni, il conseguente calcolo del Valore Patrimoniale Netto (NAV) sarà effettuato separatamente in base ai criteri sopra indicati. Tuttavia, la composizione e l'allocazione degli attivi viene sempre effettuata separatamente per il Comparto nel suo complesso.

Nel caso in cui la valutazione di un'attività in base ai principi di cui sopra risulti impossibile, errata o non rappresentativa, il Consiglio di Amministrazione ha la facoltà di utilizzare altri principi di valutazione generalmente riconosciuti e verificabili per giungere a una valutazione equa di tale attività.

## **c. Proventi del portafoglio degli investimenti**

I dividendi vengono iscritti tra i proventi alla data in cui i relativi titoli sono quotati per la prima volta ex-dividendo. I proventi da interessi sui titoli obbligazionari sono calcolati su base giornaliera.

## **d. Utili o perdite netti realizzati sulla vendita di investimenti**

Gli utili e le perdite netti realizzati sulla vendita di investimenti sono calcolati sulla base del costo medio e sono rilevati nel Conto economico e variazioni delle attività nette netto, alla voce "Utile / (perdita) netto/a realizzato/a sulla vendita di investimenti".

## **e. Bilancio consolidato**

Il Bilancio consolidato è espresso in euro, la valuta di riferimento della Società. I bilanci relativi ai singoli Comparti sono espressi nella valuta di riferimento del rispettivo Comparto.

# onemarkets Fund

## f. Costo di acquisizione dei titoli in portafoglio

Il costo di acquisizione dei titoli detenuti dai Comparti che sono denominati in valute diverse da quelle di riferimento dei Comparti è convertito in tale valuta al tasso di cambio prevalente alla data dell'acquisto.

## g. Altri oneri

Al 30 giugno 2023, la voce "Altri oneri" è composta prevalentemente da altre commissioni.

## h. Conversione delle valute estere

Le operazioni e i costi di acquisizione denominati in valuta estera sono convertiti nella valuta di conto di ciascun Comparto in base al tasso di cambio in vigore alla data dell'operazione o dell'acquisizione. Le attività e passività denominate in valuta estera sono convertite nella valuta di conto di ciascun Comparto in base al tasso di cambio in vigore alla chiusura del periodo.

Al 30 giugno 2023 i tassi di cambio impiegati erano i seguenti:

1 EUR =	1,639 AUD	1 EUR =	7,44595 DKK	1 EUR =	18,7112 MXN	1 EUR =	1,4765 SGD
1 EUR =	5,263 BRL	1 EUR =	0,85815 GBP	1 EUR =	5,0922 MYR	1 EUR =	38,6814 THB
1 EUR =	1,4437 CAD	1 EUR =	8,5497 HKD	1 EUR =	11,6885 NOK	1 EUR =	28,4424 TRY
1 EUR =	0,97605 CHF	1 EUR =	373 HUF	1 EUR =	1,7808 NZD	1 EUR =	33,97865 TWD
1 EUR =	875,14565 CLP	1 EUR =	16356,81775 IDR	1 EUR =	60,2227 PHP	1 EUR =	1,091 USD
1 EUR =	7,9368 CNH	1 EUR =	4,04865 ILS	1 EUR =	4,43265 PLN	1 EUR =	20,61035 ZAR
1 EUR =	7,9251 CNY	1 EUR =	89,50155 INR	1 EUR =	4,95925 RON		
1 EUR =	4555,7721 COP	1 EUR =	157,6877 JPY	1 EUR =	4,092 SAR		
1 EUR =	23,7585 CZK	1 EUR =	1437,55615 KRW	1 EUR =	11,78425 SEK		

## i. Oneri di costituzione

Gli oneri di costituzione sono ammortizzati a quote costanti in un periodo di 5 anni.

## 3. Commissioni di gestione

La commissione di gestione annuale (la "Commissione di gestione") comprende la commissione del Gestore degli investimenti (e, a seconda dei casi, una commissione del Subgestore degli investimenti in caso di subdelega e/o una commissione del consulente per gli investimenti che viene pagata a valere sulla commissione del Gestore degli investimenti), nonché una potenziale commissione ai Distributori (la "Commissione di distribuzione"). Un distributore può riassegnare un importo della Commissione di distribuzione ai subdistributori (se del caso).

### Commissione di Gestione delle Classi di Azioni Retail

Comparti	A	B	C	C1	M	N	O	P	U
onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)	1,25%	-	1,55%	1,55%	1,25%	1,25%	1,10%	1,10%	0,85%
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	1,25%	0,70%	1,55%	1,55%	1,25%	1,25%	1,10%	1,10%	0,85%
onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	1,70%	1,15%	2,00%	2,00%	1,70%	1,70%	1,55%	1,55%	1,20%
onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)	1,60%	1,05%	1,90%	1,90%	1,65%	1,65%	1,50%	1,50%	1,10%
onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	1,60%	1,05%	1,90%	1,90%	1,65%	1,65%	1,50%	1,50%	1,10%
onemarkets Pimco Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	1,25%	0,70%	1,55%	1,55%	1,25%	1,25%	1,10%	1,10%	0,85%
onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,35%	0,70%	1,55%	1,55%	1,40%	1,40%	1,25%	1,25%	0,90%
onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,25%	-	1,35%	1,35%	1,20%	1,20%	1,05%	1,05%	0,85%
onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	1,60%	1,05%	1,90%	1,90%	1,65%	1,65%	1,50%	1,50%	1,10%
onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,80%	1,15%	2,00%	2,00%	1,65%	1,65%	1,50%	1,50%	1,10%
onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,90%	1,25%	2,10%	2,10%	1,70%	1,70%	1,55%	1,55%	1,20%
onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,45%	0,80%	1,65%	1,65%	1,45%	1,45%	1,30%	1,30%	0,95%
onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,60%	0,90%	1,75%	1,75%	1,50%	1,50%	1,35%	1,35%	1,00%
onemarkets Global Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,60%	0,90%	1,75%	1,75%	1,50%	1,50%	1,35%	1,35%	1,00%
onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,60%	0,90%	1,75%	1,75%	1,50%	1,50%	1,35%	1,35%	1,00%
onemarkets Multi-Asset Value Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	1,60%	0,90%	1,75%	1,75%	1,50%	1,50%	1,35%	1,35%	1,00%

## onemarkets Fund

### 3. Commissioni di gestione

#### Commissione di Gestione delle Classi di Azioni Istituzionali

Comparti	D	E	I	S	V
onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)	0,70%	0,60%	0,55%	0,55%	0,60%
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	0,70%	0,60%	0,55%	0,50%	0,60%
onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	0,70%	0,60%	0,55%	0,65%	0,60%
onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)	0,70%	0,60%	0,55%	0,60%	0,60%
onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	0,70%	0,60%	0,55%	0,60%	0,60%
onemarkets Pimco Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	0,70%	0,60%	0,55%	0,50%	0,60%
onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,50%	0,60%
onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,50%	0,60%
onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	0,70%	0,60%	0,55%	0,60%	0,60%
onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,60%	0,60%
onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,65%	0,60%
onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,50%	0,60%
onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,55%	0,60%
onemarkets Global Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,55%	0,60%
onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,55%	0,60%
onemarkets Multi-Asset Value Fund (lanciato il 30 giugno 2023)	0,70%	0,60%	0,55%	0,55%	0,60%

### 4. Commissioni del depositario

Se non diversamente indicato nelle Informazioni specifiche del Comparto, il Depositario ha diritto a percepire commissioni (la "Commissione del Depositario") a valere sulle attività del Fondo, ai sensi del relativo accordo tra il Depositario e il Fondo e in conformità alle consuete prassi di mercato. Le commissioni dovute al Depositario (escluse le commissioni del sub-depositario e le eventuali commissioni di transazione) non supereranno lo 0,065% annuo del valore patrimoniale netto medio del rispettivo Comparto. Le commissioni sono calcolate e maturano ogni Giorno di Valutazione e sono pagabili trimestralmente in via posticipata.

### 5. Commissioni di amministrazione

La commissione di amministrazione annua (la "Commissione di Amministrazione") remunera la Società di Gestione per i suoi servizi di gestione del patrimonio dei Comparti.

L'Agente per l'Amministrazione dell'OICR ha diritto di percepire commissioni a valere sulla Commissione di Amministrazione, ai sensi del relativo accordo tra l'Agente Amministrazione dell'OICR e la Società di Gestione e in conformità alle consuete prassi di mercato. Le commissioni sono calcolate e maturano ogni Giorno di Valutazione e sono pagabili trimestralmente in via posticipata.

Comparti	Commissione di Amministrazione annua sul NAV*	Minimo
onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)	0,20%	EUR 80.000 all'anno più costi di transazione aggiuntivi
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	0,20%	EUR 80.000 all'anno più costi di transazione aggiuntivi
onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	0,25%	EUR 80.000 all'anno più costi di transazione aggiuntivi
onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)	0,25%	EUR 80.000 all'anno più costi di transazione aggiuntivi
onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	0,25%	EUR 80.000 all'anno più costi di transazione aggiuntivi
onemarkets Pimco Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	0,20%	EUR 80.000 all'anno più costi di transazione aggiuntivi
onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	0,25%	EUR 80.000 all'anno più costi di transazione aggiuntivi

\*A partire dal 1° luglio 2023, la Commissione di Amministrazione fino allo 0,40% sarà applicata a tutti i Comparti.

# onemarkets Fund

## 6. Commissioni di transazione

Le commissioni di transazione per le transazioni su titoli e operazioni simili sono registrate separatamente nel conto economico e nel prospetto delle variazioni delle attività nette.

## 7. Distribuzione di dividendi

Quando nella denominazione della Classe di Azioni è incluso l'indicatore FQD, il Fondo preannuncia un dividendo target distribuito su base trimestrale. Un dividendo target è un importo che il Comparto mira a versare, ma non garantisce. I dividendi target possono essere indicati come un importo specifico in valuta o come una percentuale del NAV. Per rispettare l'importo del dividendo target, un Comparto può decidere di distribuire più di quanto ha effettivamente guadagnato in dividendi: in questo caso gli azionisti riceveranno parte del capitale sotto forma di dividendo.

Nell'esercizio concluso il 30 giugno 2023, il Fondo ha distribuito i seguenti dividendi:

Comparto	Classe di Azioni	ISIN	Valuta	Dividendo per azione	Dividendo complessivo	Data ex dividendo	Data di pagamento
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	EFQD	LU2503841657	EUR	0,98	420.830,53	30/01/2023	31/01/2023
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	EFQD	LU2503841657	EUR	0,98	363.393,26	27/04/2023	28/04/2023

## 8. Variazioni nella composizione del portafoglio

I dettagli delle variazioni della composizione del portafoglio per il periodo concluso il 30 giugno 2023 sono a disposizione degli azionisti presso la sede legale della Società e sono disponibili gratuitamente su richiesta.

## 9. Taxe d'abonnement

Nel Granducato di Lussemburgo le attività del Fondo sono soggette solo alla taxe d'abonnement, attualmente pari allo 0,05% annuo. Una taxe d'abonnement ridotta dello 0,01% annuo del patrimonio netto, calcolata e pagabile alla fine di ogni trimestre, è applicabile a (i) Comparti o Classi le cui Azioni sono emesse esclusivamente a favore di Investitori Istituzionali ai sensi dell'articolo 174 della Legge del 2010, (ii) Comparti il cui unico scopo è investire in Strumenti del Mercato Monetario, in depositi a tempo determinato presso istituti di credito o in entrambi, (iii) Comparti il cui scopo è investire in microfinanziamenti.

La taxe d'abonnement è pagabile trimestralmente sulla base del patrimonio netto del Fondo rilevato alla fine di ogni trimestre.

L'esenzione dalla taxe d'abonnement si applica, tra l'altro, nella misura in cui le attività del Fondo sono investite in altri fondi d'investimento lussemburghesi, a loro volta soggetti alla taxe d'abonnement.

## onemarkets Fund

### 10. Garanzie

Nella tabella che segue sono riportate le garanzie detenute o pagate per gestire l'esposizione nei confronti della controparte sui derivati OTC:

Comparti	Controparte	Valuta	Garanzie in contanti pagate dal Fondo a favore della Controparte	Garanzie in contanti detenute dalla Controparte a favore del Fondo
onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)	UBS Europe SE	EUR	-	260.000,00
onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)	BofA Securities Europe	EUR	-	330.000,00
onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)	Standard Chartered Bank Londra	EUR	-	20.000,00
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	Société Générale	EUR	-	260.000,00
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	J.P. Morgan AG	EUR	260.000,00	-
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	BofA Securities Europe	EUR	-	940.000,00
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	Morgan Stanley Bk AG	EUR	-	180.000,00
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	Goldman Sachs Bank Europe SE	EUR	-	600.000,00
onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)	Citigroup Global Markets Europe AG	EUR	-	1.710.000,00
onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	HSBC Bank	EUR	36.663,61	-
onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	State Street Bank Intl GmbH	EUR	-	9.165,90
onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)	UBS Europe SE	EUR	-	18.331,81
onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	Barclays Bank PLC	EUR	-	43.430,67
onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	Barclays Bank PLC	EUR	959.000,00	-
onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	Standard Chartered Bank Londra	EUR	30.000,00	-
onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	Barclays Bank PLC	EUR	-	280.000,00
onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)	Barclays Bank PLC	EUR	-	459.168,53

### 11. Eventi successivi

Comparto onemarkets VP Global Flexible Bond Fund, lanciato il 3 luglio 2023.

Comparto onemarkets VP Flexible Allocation Fund, lanciato il 3 luglio 2023.



## Altre informazioni (non certificate)

### 1. Politica di remunerazione

Structured Invest S.A. (la "Società di Gestione") è inclusa nella strategia di remunerazione del Gruppo UniCredit. Tutti le questioni che riguardano la remunerazione e la conformità ai requisiti normativi sono gestite dai comitati competenti del Gruppo UniCredit. La politica di remunerazione promuove ed è coerente con una politica di gestione del rischio solida ed efficace e non incoraggia l'assunzione di rischi non in linea con i profili di rischio, le condizioni contrattuali o gli Statuti dei fondi gestiti dalla Società di Gestione. È conforme alla strategia aziendale, agli obiettivi, ai valori e agli interessi della Società di Gestione, dei fondi che gestisce e di chi investe in tali fondi, e comprende misure volte a prevenire conflitti di interesse. La strategia di remunerazione consente un equilibrio tra le componenti retributive fisse e variabili e definisce i meccanismi di corresponsione della remunerazione variabile. Le componenti fisse e variabili della remunerazione sono opportunamente proporzionate tra di loro, con una percentuale della componente fissa della remunerazione totale sufficientemente elevata da offrire completa flessibilità in relazione alle componenti retributive variabili, inclusa la possibilità di trattenere la corresponsione di una componente variabile.

Structured Invest S.A. ha definito un sistema di remunerazione che evita un significativo ricorso alla componente variabile della remunerazione. Nella determinazione della remunerazione variabile dei dipendenti, Structured Invest S.A. si concentra sulla loro performance individuale, sulla performance della divisione di cui fanno parte e sui risultati aziendali. Le performance dei fondi o dei comparti gestiti da Structured Invest S.A. non viene considerata nella determinazione della remunerazione variabile. Il sistema di remunerazione della Società di Gestione viene rivisto almeno una volta all'anno. Nessun cambiamento di rilievo è stato apportato al sistema di remunerazione in uso durante l'esercizio finanziario della Società di Gestione. La Società di Gestione ha individuato i dipendenti le cui attività professionali hanno un impatto rilevante sui profili di rischio della Società di Gestione o sui fondi che gestisce, sulla base dei criteri specificati nel Regolamento Delegato della Commissione (UE) 604/2014.

La Società di Gestione ha individuato nove dipendenti con queste caratteristiche.

La remunerazione variabile corrisposta dalla Società di Gestione ai suoi dipendenti nell'ultimo esercizio finanziario è pari a EUR 1.002.366,53, ripartita in EUR 780.690,38 di remunerazione fissa e EUR 221.676,15 di remunerazione variabile.

La Società di Gestione non ha pagato alcuna commissione di performance.

Non ci sono collegamenti tra il Fondo e/o il profilo di rischio del Fondo e i contratti di lavoro di dirigenti e dipendenti. Le informazioni riportate si riferiscono alla Società di Gestione nel suo insieme e non ai singoli fondi.

Al 31 dicembre 2022, la Società di Gestione gestiva 19 fondi di investimento alternativi (FIA) e 17 OICVM, con un patrimonio gestito totale pari a EUR 3.081.106.515,77.

Le informazioni correnti riguardo al sistema di remunerazione sono reperibili nel sito Internet di Structured Invest S.A. al seguente indirizzo: <https://www.structuredinvest.lu/de/de/fondsplattform/ueber-uns.html>.

Lussemburgo, ottobre 2023

**Structured Invest S.A.**

---

<sup>1</sup> Queste cifre sono riferite all'esercizio finanziario concluso il 31 dicembre 2022.

# onemarkets Fund

## 2. Procedura di gestione del rischio

Come previsto dalle Circolari CSSF 11/512 e 18/698, il Consiglio di Amministrazione deve determinare l'esposizione globale al rischio del Fondo applicando il metodo degli impegni ("Commitment approach") o il metodo VaR ("Value at Risk").

### onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando la metodologia del Value at Risk (VaR) assoluto.

#### DATI DI RISCHIO PER IL PERIODO DAL 5 OTTOBRE AL 30 GIUGNO 2023

onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund (lanciato il 5 ottobre 2022)		
Misura del rischio <sup>1</sup>		
Value at Risk		4,27%
Leva <sup>2</sup>		946,60%
Limite VaR <sup>3</sup>	15%	Monte-Carlo
Utilizzo minimo <sup>4</sup>	0,00% Livello di confidenza	99%
Utilizzo massimo <sup>4</sup>	88,71% Periodo di detenzione	20 giorni
Utilizzo medio <sup>4</sup>	46,82% Durata della serie storica	250 giorni

### onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando la metodologia del Value at Risk (VaR) assoluto.

#### DATI DI RISCHIO PER IL PERIODO DAL 28 SETTEMBRE AL 30 GIUGNO 2023

onemarkets Amundi Flexible Income Fund (lanciato il 28 settembre 2022)		
Misura del rischio <sup>1</sup>		
Value at Risk		5,22%
Leva <sup>2</sup>		218,24%
Limite VaR <sup>3</sup>	10%	Monte-Carlo
Utilizzo minimo <sup>4</sup>	0,00% Livello di confidenza	99%
Utilizzo massimo <sup>4</sup>	94,51% Periodo di detenzione	20 giorni
Utilizzo medio <sup>4</sup>	62,47% Durata della serie storica	250 giorni

### onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund (lanciato il 28 settembre 2022)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

### onemarkets Fidelity World Equity Income Fund (lanciato il 29 settembre 2022)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

<sup>1</sup>La misura di rischio indica il valore della perdita del portafoglio con una probabilità del 99,00% in un periodo di detenzione di 20 giorni.

<sup>2</sup>Media dei valori di valutazione giornalieri dell'effetto leva nel periodo di attività.

<sup>3</sup> Limite normativo

<sup>4</sup> Utilizzo relativo del limite normativo dichiarato.

# onemarkets Fund

## onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando la metodologia del Value at Risk (VaR) relativo.

### DATI DI RISCHIO PER IL PERIODO DAL 30 SETTEMBRE AL 30 GIUGNO 2023

onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund (lanciato il 30 settembre 2022)		
Misura del rischio <sup>1</sup>		
Value at Risk		10,25%
Leva <sup>2</sup>		29,90%
Limite VaR <sup>3</sup>	200% del VaR del portafoglio di riferimento <sup>5</sup>	Monte-Carlo
Utilizzo minimo <sup>4</sup>	39,53% Livello di confidenza	99%
Utilizzo massimo <sup>4</sup>	90,06% Periodo di detenzione	20 giorni
Utilizzo medio <sup>4</sup>	62,58% Durata della serie storica	250 giorni

## onemarkets Pimco Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando la metodologia del Value at Risk (VaR) assoluto.

### DATI DI RISCHIO PER IL PERIODO DAL 11 OTTOBRE AL 30 GIUGNO 2023

onemarkets Pimco Global Balanced Allocation Fund (lanciato l'11 ottobre 2022)		
Misura del rischio <sup>1</sup>		
Value at Risk		2,52%
Leva <sup>2</sup>		75,51%
Limite VaR <sup>3</sup>	15%	Monte-Carlo
Utilizzo minimo <sup>4</sup>	32,20% Livello di confidenza	99%
Utilizzo massimo <sup>4</sup>	82,02% Periodo di detenzione	20 giorni
Utilizzo medio <sup>4</sup>	16,08% Durata della serie storica	250 giorni

## onemarkets PIMCO Global Strategic Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando la metodologia del Value at Risk (VaR) assoluto, che non è calcolata alla data di rendicontazione.

## onemarkets PIMCO Global Short Term Bond Fund (lanciato il 30 giugno 2023)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando la metodologia del Value at Risk (VaR) assoluto, che non è calcolata alla data di rendicontazione.

## onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund (lanciato il 30 settembre 2022)

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

<sup>1</sup>La misura di rischio indica il valore della perdita del portafoglio con una probabilità del 99,00% in un periodo di detenzione di 20 giorni.

<sup>2</sup>Media dei valori di valutazione giornalieri dell'effetto leva nel periodo di attività.

<sup>3</sup> Limite normativo

<sup>4</sup> Utilizzo relativo del limite normativo dichiarato.

<sup>5</sup>Il portafoglio di riferimento è l'indice MSCI ACWI.

# onemarkets Fund

---

## **onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

## **onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

## **onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

## **onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

## **onemarkets Global Multibrand Selection Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

## **onemarkets Balanced Eastern Europe Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

## **onemarkets Multi-Asset Value Fund (lanciato il 30 giugno 2023)**

Nell'ambito della procedura di gestione del rischio, l'esposizione globale sarà misurata e controllata utilizzando il metodo degli impegni ("Commitment approach").

## onemarkets Fund

### 3. Indicatore sintetico di spesa

L'indicatore sintetico di spesa (Total Expense Ratio o "TER") esprime, come percentuale delle attività nette medie, la somma di tutte gli oneri operativi imputati ai Comparti, calcolati su un periodo di 12 mesi.

Codice ISIN	Comparti	Classi di Azioni	TER al 30/06/2023
LU2503833399	onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund	A - EUR	1,76%
LU2503840923	onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund	C - EUR	1,99%
LU2503840840	onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund	M - EUR	1,61%
LU2503840766	onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund	MD - EUR	1,61%
LU2503840097	onemarkets Amundi Absolute Return Growth Fund	E - EUR	0,80%
LU2503839750	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	A - EUR	1,59%
LU2503839677	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	AD - EUR	1,59%
LU2503839321	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	C - EUR	1,88%
LU2503839248	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	CD - EUR	1,89%
LU2503839164	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	M - EUR	1,59%
LU2503839081	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	MD - EUR	1,58%
LU2503838943	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	O - EUR	1,42%
LU2503838869	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	OD - EUR	1,42%
LU2503838786	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	U - EUR	1,16%
LU2503842622	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	E - EUR	0,95%
LU2503841657	onemarkets Amundi Flexible Income Fund	EFQD - EUR	0,90%
LU2503843604	onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund	A - EUR	2,10%
LU2503843430	onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund	C - EUR	2,39%
LU2503843356	onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund	M - EUR	2,11%
LU2503843273	onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund	MD - EUR	2,12%
LU2503843190	onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund	O - EUR	1,93%
LU2503842978	onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund	OD - EUR	1,95%
LU2503844081	onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund	U - EUR	1,73%
LU2503842465	onemarkets Amundi Climate Focus Equity Fund	E - EUR	1,00%
LU2503842119	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	A - EUR	1,98%
LU2503842036	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	AD - EUR	1,98%
LU2503841905	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	C - EUR	2,27%
LU2503841814	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	CD - EUR	2,27%
LU2503841731	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	M - EUR	2,04%
LU2503838604	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	MD - EUR	2,04%
LU2503838513	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	O - EUR	1,88%
LU2503838430	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	OD - EUR	1,89%
LU2503836905	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	U - EUR	1,65%
LU2503835410	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	UD - EUR	1,46%
LU2503835337	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	D - EUR	1,10%
LU2503835253	onemarkets Fidelity World Equity Income Fund	E - EUR	0,92%
LU2503837036	onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund	A - EUR	2,01%
LU2503836814	onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund	C - EUR	2,30%
LU2503836731	onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund	M - EUR	2,04%
LU2503836657	onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund	MD - EUR	2,05%
LU2503836574	onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund	O - EUR	1,92%
LU2503836491	onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund	OD - EUR	1,86%
LU2503836228	onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund	U - EUR	1,64%
LU2503835923	onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunies Fund	E - EUR	1,08%
LU2503835501	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	A - EUR	1,70%
LU2503835683	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	AD - EUR	1,67%
LU2503835766	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	C - EUR	2,00%
LU2503835840	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	CD - EUR	2,02%
LU2503838273	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	M - EUR	1,59%
LU2503837978	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	MD - EUR	1,63%
LU2503837895	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	O - EUR	1,44%
LU2503837622	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	OD - EUR	1,40%
LU2503837200	onemarkets PIMCO Global Balanced Allocation Fund	E - EUR	3,28%
LU2503834520	onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund	A - EUR	1,99%
LU2503834447	onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund	C - EUR	2,28%
LU2503834363	onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund	M - EUR	2,04%
LU2503834280	onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund	MD - EUR	2,02%
LU2503834108	onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund	O - EUR	1,83%
LU2503834017	onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund	OD - EUR	1,85%
LU2503833712	onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund	D - EUR	1,12%
LU2503833639	onemarkets J.P. Morgan Emerging Countries Fund	E - EUR	0,99%

Alcuni indicatori TER non vengono comunicati, in quanto l'attività del Comparto durante l'esercizio in esame è stata inferiore a 3 mesi e/o le loro commissioni sono inferiori a EUR 500 o hanno chiuso durante l'esercizio.

## onemarkets Fund

---

#### **4. Informazioni relative alla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo di garanzie consistenti in disponibilità liquide (regolamento UE 2015/2365, di seguito "SFTR")**

Obblighi relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli - Regolamento sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTR)

Il 23 dicembre 2015 è stato pubblicato nella Gazzetta ufficiale dell'Unione europea il Regolamento (UE) 2015/2365 sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e sul riutilizzo e modifica del Regolamento (UE) n. 648/2012 (SFTR).

L'SFTR regola essenzialmente gli obblighi relativi alle "operazioni di finanziamento tramite titoli" (SFT). L'SFTR prevede ulteriori obblighi di segnalazione con riferimento alla conclusione, modifica o cessazione di operazioni SFT in aggiunta agli obblighi di segnalazione già in vigore in base al regolamento EMIR (che, tuttavia, non sono applicabili in linea di principio alle operazioni SFT).

Al 30 giugno 2023, nessuno dei Comparti di onemarkets Fund ha impiegato strumenti finanziari inclusi nell'ambito di applicazione del regolamento SFTR 2015/2365.

## onemarkets Fund

---

5. SFDR (Regolamento relativo all'informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari)

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

**Nome del prodotto:**

Onemarkets Amundi Absolute  
Return Growth Fund

**Identificativo della persona giuridica (LEI):**

529900OXAL2HZM23TO54

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche sostenibili dal punto di vista sociale. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

**Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?**



**Sì**



**No**



Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale:**



in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE



in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE



Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale:** \_\_\_\_\_



Ha **promosso caratteristiche ambientali/sociali (E/S)** e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una percentuale del **33,50%** di investimenti sostenibili



in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**



**In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Il Comparto ha promosso caratteristiche ambientali e/o sociali rispettando il quadro di analisi ESG e la metodologia di scoring di Amundi, che include un insieme di approcci basati su esclusione, integrazione ESG e engagement.

Le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario sono incorporate nei criteri identificati per eseguire il quadro di analisi ESG.

Questi criteri sono differenti per le imprese che emettono strumenti quotati e per le entità sovrane.

Per gli emittenti corporate, la nostra analisi ESG è formata da 38 criteri, di cui 17 sono intersettoriali, comuni a tutte le imprese, a prescindere dal loro settore di attività, e 21



sono criteri specifici per settore. Tali criteri sono stati ideati per valutare in che misura problematiche inerenti la sostenibilità possono influenzare l'emittente, nonché la qualità della gestione di questa dimensione. Sono stati considerati anche gli effetti sui fattori di sostenibilità, nonché la qualità delle attività di mitigazione intraprese. Tutti i criteri sono presenti nel sistema di gestione del portafoglio di front office dei gestori di fondi.

#### Criteri specifici per settore

##### Ambiente

- Energia pulita
- Auto ecologiche (green)
- Chimica green
- Edilizia sostenibile
- Gestione responsabile delle foreste
- Riciclo della carta
- Investimenti e finanziamenti green
- Assicurazioni green
- Green business
- Imballaggi

##### Sociali

- Bioetica
- Marketing responsabile
- Prodotto salutare
- Rischio del tabacco
- Sicurezza dei veicoli
- Sicurezza dei passeggeri
- Media responsabili
- Sicurezza dei dati e privacy
- Divario digitale
- Accesso alla medicina
- Inclusione finanziaria

#### Criteri intersettoriali

##### Ambiente

- Emissioni ed energia
- Gestione idrica
- Biodiversità e inquinamento
- Catena di approvvigionamento - Ambiente

##### Sociali

- Salute e sicurezza
- Condizioni di lavoro
- Relazioni sindacali
- Catena di approvvigionamento - Sociale 2
- Responsabilità di Prodotto e Cliente
- Coinvolgimento della comunità e Diritti umani

##### Governance

- Struttura del Consiglio di Amministrazione
- Audit e controllo
- Retribuzione
- Diritti degli azionisti
- Etica
- Pratiche fiscali
- Strategia ESG

La misura in cui questi criteri influenzano il punteggio ESG dell'emittente dipende dall'importanza relativa loro attribuita nel modello rispetto agli altri fattori considerati. Ogni emittente è stato valutato con un punteggio rapportato alla media del suo settore, al fine di distinguere tra migliori e peggiori prassi del settore.

Per quanto riguarda gli emittenti sovrani, la metodologia di Amundi si basa su una serie di circa 50 indicatori ESG. Tutti gli indicatori sono stati raggruppati in 8 categorie, ciascuna delle quali rientra in uno dei pilastri ESG. Parimenti alla nostra scala di rating ESG corporate, il punteggio ESG degli emittenti è convertito in un rating ESG compreso tra A e G:

##### Ambiente

- Cambiamento climatico
- Capitale naturale

##### Sociali

- Diritti umani
- Coesione sociale
- Capitale umano
- Diritti civili

##### Governance

- Efficacia delle azioni di governo
- Congiuntura economica

Non è stato stabilito alcun benchmark di riferimento per il conseguimento delle caratteristiche ambientali e sociali promosse.

Gli indicatori di sostenibilità misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

### ● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Amundi ha sviluppato internamente un processo di rating ESG proprietario basato sull'approccio "best in class".

Gli indicatori di sostenibilità impiegati per misurare il conseguimento delle caratteristiche ambientali o sociali sono stati il rating ESG assegnato a ciascun strumento finanziario secondo una metodologia proprietaria, il rating ESG del portafoglio risultante e il rating ESG del benchmark o dell'universo di investimento.

Riguardo al rating ESG, Amundi ha basato la propria analisi ESG delle imprese su un approccio "best-in-class". Ogni emittente è stato valutato con un punteggio quantitativo dimensionato sulla media del proprio settore, che ha consentito di distinguere le migliori prassi dalle peggiori a livello settoriale. La valutazione di Amundi si è basata su una combinazione di dati non finanziari provenienti da terzi e sull'analisi qualitativa dei temi settoriali e di sostenibilità associati. Il punteggio quantitativo si è tradotto in un rating, espresso mediante una lettera, su una scala compresa tra A (per le prassi migliori) e G (per le peggiori). Le società con rating G sono state escluse dagli investimenti di questo fondo. Il rating ESG di ogni emittente è ricavato dall'aggregazione dei rating relativi alle dimensioni ambientale, sociale e di corporate governance.

Il rating ESG complessivo del portafoglio è la media ponderata in base alla raccolta gestita (AuM) dei rating ESG di ogni emittente. Il Rating ESG del portafoglio deve essere superiore a quello del benchmark o dell'universo di investimento.

Al termine del periodo:

- Il Rating ESG medio ponderato del portafoglio è pari a **0,61 (C)**
- Il Rating ESG medio ponderato dell'indice di riferimento è pari a **0,00 (D)**

In aggiunta, Amundi ha applicato una politica di esclusione mirata relativamente agli emittenti che non rispettano la [Politica di investimento responsabile del Gruppo Amundi](#), ad esempio emittenti esposti alle regole e soglie di esclusione riportate nella nostra politica settoriale (ad es. carbone termico, tabacco), o che non rispettano le convenzioni e/o quadri riconosciuti a livello internazionale e le normative nazionali.

### ● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

Gli indicatori sostenibili di cui sopra non sono stati confrontati con periodi precedenti in quanto la normativa non era ancora in vigore.

### ● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha parzialmente effettuato e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Gli investimenti sostenibili hanno come obiettivo investire in società partecipate che cercano di soddisfare due criteri:

1. aderire alle migliori prassi ambientali e sociali; ed
2. evitare la produzione di prodotti o la fornitura di servizi che danneggiano l'ambiente e la società.

Perché la società partecipata sia considerata un contributo all'obiettivo di cui sopra deve essere un "best performer" nel proprio settore di attività o riguardo ad almeno uno dei fattori ambientali o sociali significativi.

La definizione di "best performer" si basa sulla metodologia ESG proprietaria di Amundi, che mira a misurare la performance ESG di una società partecipata. Per essere considerata una "best performer", l'azienda scelta deve avere una performance valutata con uno dei tre migliori rating (A, B o C, su una scala compresa tra A e G) all'interno del

proprio settore per almeno un fattore ambientale o sociale significativo. I fattori ambientali e sociali significativi sono identificati a livello settoriale. L'identificazione dei fattori significativi si basa sullo schema di analisi ESG di Amundi, che integra dati non finanziari e l'analisi qualitativa del settore e delle tematiche di sostenibilità associate. I fattori identificati come significativi contribuiscono per oltre il 10% al punteggio ESG complessivo. Per il settore energia, ad esempio, i fattori significativi sono: emissioni ed energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa di settori e fattori, si rimanda alla Dichiarazione Regolativa di Amundi in materia ESG ([Amundi ESG Regulatory Statement](#)).

Per contribuire agli obiettivi di cui sopra, la società partecipata non dovrebbe avere un'esposizione significativa ad alcune attività non compatibili con questi criteri (ad esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carne, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso).

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello della società partecipata.

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e la lotta alla corruzione e alla concussione.

● ***In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato un danno significativo a qualsiasi obiettivo di investimento sostenibile ambientale e sociale?***

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino danni significativi ("DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori dei principali effetti negativi riportati nell'Allegato 1, Tabella 1 dell'RTS (ad es. PAI 3 Intensità dei gas serra delle società partecipate, PAI 13 Diversità del Consiglio di Amministrazione) mediante un insieme di indicatori (ad es. intensità di carbonio) e soglie o regole specifiche (ad es., l'intensità di carbonio della società partecipata non deve rientrare nell'ultimo decile del settore).

Amundi considera già alcuni Principali effetti negativi specifici nell'ambito della propria politica di esclusione come parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta alle prove illustrate sopra, riguardano i seguenti temi: esclusioni per armi controverse, violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite, carbone e tabacco.

Oltre ai fattori specifici di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non prende in considerazione gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi di cui sopra, al fine di verificare che l'impresa non abbia una performance carente dal punto di vista ambientale o sociale generale rispetto ad altre imprese del settore, e corrisponda così a un punteggio ambientale o sociale superiore o pari a E, utilizzando il rating ESG di Amundi.

- ***In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?***

Sono stati presi in considerazione tutti gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi per assicurare che gli investimenti sostenibili del Comparto non abbiano arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento ambientale o sociale.

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi riportati nell'Allegato 1, Tabella 1 del Regolamento Delegato (UE) 2022/1288 mediante la combinazione dei seguenti indicatori e soglie o regole specifiche:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre imprese del settore (si applica solo a settori ad alta intensità), e
- avere un grado di diversità del Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto ad altre imprese del settore, e

- non avere in corso alcuna controversia relativa a condizioni di lavoro e diritti umani.
- non avere in corso alcuna controversia relativa a biodiversità e inquinamento.

Amundi considera già alcuni Principali effetti negativi specifici nell'ambito della propria politica di esclusione come parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta alle prove illustrate sopra, riguardano i seguenti temi: esclusioni per armi controverse, violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite, carbone e tabacco.

– ***Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:***

Gli investimenti sostenibili del Comparto erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani.

Le Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali e i Principi guida delle Nazioni Unite sono integrate nella nostra metodologia di scoring ESG. Il nostro strumento proprietario di rating ESG valuta gli emittenti utilizzando dati disponibili forniti dai nostri provider di dati. Il modello, ad esempio, include un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della comunità e Diritti umani" che si applica a tutti i settori in aggiunta agli altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di approvvigionamento socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Svolgiamo, inoltre, un'attività di monitoraggio delle controversie, a cadenza almeno trimestrale, che include le imprese individuate a causa di violazioni dei diritti umani. Quando si verificano delle controversie, gli analisti valutano la situazione e assegnano alla controversia un punteggio (impiegando la nostra metodologia proprietaria di scoring) e stabiliscono la migliore linea d'azione. I punteggi relativi alle controversie sono aggiornati trimestralmente per monitorarne l'andamento e gli sforzi di correzione.



**In che modo il presente prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

Il prodotto considera tutti i Principali effetti negativi obbligatori di cui all'Allegato 1, Tabella 1 del Regolamento Delegato (UE) 2022/1288 inerenti la strategia del prodotto e fa affidamento su una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali), e approcci di "engagement and voting":

- **Esclusione:** Amundi ha definito regole di esclusione sulla base di normative, tipologie di attività e settori che includono alcuni dei principali indicatori negativi di sostenibilità elencati nel Regolamento sulle disclosure (SFDR).
- **Integrazione di fattori ESG:** Amundi ha adottato standard minimi di integrazione ESG applicati per impostazione predefinita ai suoi fondi aperti gestiti attivamente (esclusione degli emittenti con rating G e punteggio ESG medio ponderato migliore più alto rispetto al benchmark applicabile). I 38 criteri utilizzati nell'approccio di valutazione ESG Amundi sono stati ideati anche per considerare i principali effetti sulla sostenibilità, nonché la qualità delle attività di mitigazione intraprese.
- **Engagement:** L'engagement o coinvolgimento è un processo continuo e mirato, finalizzato a influenzare le attività o il comportamento delle società partecipate. L'obiettivo delle attività di coinvolgimento può rientrare in due categorie: impegnare un emittente a migliorare la modalità di integrazione della dimensione ambientale e sociale; impegnare un emittente a migliorare il proprio impatto su aspetti ambientali, sociali, e relativi ai diritti umani o altrimenti attinenti alla sostenibilità, che rivestono un'importanza materiale per la società e l'economia globale.
- **Voto:** la politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutti gli aspetti a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, inclusi gli aspetti ESG rilevanti. Per maggiori informazioni, si rimanda alla Politica di voting di Amundi.
- **Monitoraggio delle controversie:** Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie basato su tre fornitori terzi di dati per monitorare in modo sistematico le controversie e il loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo è poi arricchito dalla valutazione approfondita di ogni controversia grave, diretta da analisti ESG e dall'esame periodico della sua evoluzione. Questo approccio si applica a tutti i fondi di Amundi.

INDICATORI RELATIVI AL CLIMA E AD ALTRI ASPETTI AMBIENTALI		
Indicatore negativo di sostenibilità		Azioni intraprese e programmate e target fissati per il prossimo periodo di riferimento
Emissioni di gas serra	1. Emissioni di gas serra (GHG)	Engagement Voting Integrazione di fattori ESG
	2. Impronta di carbonio	Engagement Voting Integrazione di fattori ESG
	3. Intensità dei gas serra delle società partecipate	Engagement Voting Integrazione di fattori ESG
	4. Esposizione verso imprese operanti nel settore dei combustibili fossili	Engagement Voting Esclusione
	5. Quota di consumi e produzione di energia non rinnovabile	Engagement Integrazione di fattori ESG

	6. Intensità del consumo energetico per settore ad alto impatto climatico	Engagement Integrazione di fattori ESG
Biodiversità	7. Attività che influenzano negativamente aree sensibili alla biodiversità	Engagement Voting Monitoraggio delle controversie Integrazione di fattori ESG
Acqua	8. Emissioni in acqua	Engagement Monitoraggio delle controversie Integrazione di fattori ESG
Rifiuti	9. Rapporto tra rifiuti pericolosi e rifiuti radioattivi	Engagement Monitoraggio delle controversie Integrazione di fattori ESG
INDICATORI SU ASPETTI SOCIALI E RELATIVI AI DIPENDENTI, RISPETTO DEI DIRITTI UMANI, LOTTA ALLA CORRUZIONE E ALLA CONCUSSIONE		
Aspetti sociali e relativi ai dipendenti	10. Violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite e delle Linee guida per le Imprese Multinazionali dell'Organizzazione per la Cooperazione e lo Sviluppo Economico (OCSE)	Engagement Voting Monitoraggio delle controversie Esclusione
	11. Mancanza di processi e meccanismi di compliance ai Principi del Global Compact delle Nazioni Unite e alle Linee Guida per le Imprese Multinazionali dell'OCSE	Engagement Voting Monitoraggio delle controversie
	12. Divario retributivo di genere non rettificato	Engagement Voting Monitoraggio delle controversie
	13. Diversità di genere nel Consiglio di Amministrazione	Engagement Voting
	14. Esposizione ad armi controverse (mine antiuomo, munizioni a grappolo, armi chimiche e armi biologiche)	Voting Esclusione
Indicatori applicabili a investimenti in titoli sovrani e sovranazionali		
Ambientali	15. Intensità GHG	Integrazione di fattori ESG
Sociali	16. Paesi di investimento soggetti a violazioni sociali	Esclusione



## Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la **quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: **dal 01/07/2022 al 30/06/2023**

Maggiori investimenti	Settore	% Attività	Paese
AMUNDI PHYSICAL GOLD ETC (AMSTERDAM)	Fondi comuni	3,94%	IRL
CANADA 1% 09/26	Titoli di Stato	1,27%	CAN
BRAZIL 10% 01/29 NTN	Titoli di Stato	1,10%	BRA
KFW % 09/30 EMTN	Agenzie	1,04%	DEU
AMND STXAA5 ENR ETF(MIL)	Fondi comuni	0,99%	LUX
AMND MSCI EUROPE QUAL FACT ETF EUR-C	Fondi comuni	0,92%	LUX
BRAZIL 10% 01/33 NTN	Titoli di Stato	0,90%	BRA
EU 0,8% 07/25 NGEU	Sovranazionali	0,88%	BEL
SWISS 2,50% 03/36	Titoli di Stato	0,84%	CHE
ISHARES AUTOMATION / ROBOTICS -A	Fondi comuni	0,82%	IRL
MBONO 7,5% 05/33 M	Titoli di Stato	0,75%	MEX
EU 0% 07/26 NGEU	Sovranazionali	0,70%	BEL
WisdomTree Brent Crude Oil ETC	Fondi comuni	0,63%	JEY
US TSY 0,375% 04/25	Titoli di Stato	0,62%	USA
KFW 0% 09/26 EMTN	Agenzie	0,62%	DEU

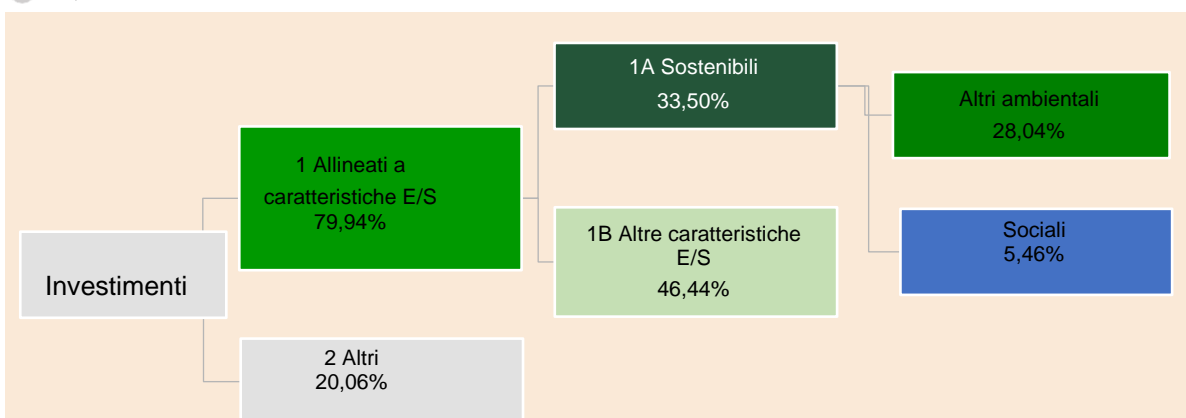


## Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?

Il Comparto ha investito il 33,50% delle sue attività in investimenti sostenibili. Di questi, lo 0% era allineato alla Tassonomia UE. Il 28,04% degli investimenti sostenibili sono considerati altri investimenti ecosostenibili e il 5,46% investimenti socialmente sostenibili. Il 46,66% degli investimenti del Comparto sono utilizzati per conseguire la caratteristica del Comparto durante il periodo di riferimento e non sono considerati investimenti sostenibili.

Il 20,06% degli investimenti, ovvero la quota restante, non sono né investimenti sostenibili, né investimenti utilizzati per raggiungere le caratteristiche promosse dal Comparto.

### Qual è stata l'asset allocation?



L'Asset allocation descrive la quota di investimenti in asset specifici.

**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali e sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati alle caratteristiche ambientali o sociali e non si qualificano come investimenti sostenibili.

La categoria **1 Allineati alle caratteristiche E/S** comprende:

- La sottocategoria **1A Sostenibili** include gli investimenti sostenibili a livello ambientale e sociale.
- La sottocategoria **1B Altre caratteristiche E/S** include investimenti in linea con le caratteristiche ambientali o sociali che non si qualificano come investimenti sostenibili.



● ***In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?***

<b>Settori / Sottosettori</b>	<b>% delle attività nette</b>
Banche e altre istituzioni finanziarie	15,27
Elettronica e semiconduttori	14,00
Internet e servizi Internet	11,55
Holding e società finanziarie	6,40
Cibi e bevande non alcoliche	5,85
Fondi di investimento	5,79
Ingegneria elettrica ed elettronica	5,50
Petrolio	4,07
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	3,80
Assicurazione	2,95
Veicoli stradali	2,37
Prodotti farmaceutici e cosmetici	2,06
Forniture per ufficio e informatica	2,06
Comunicazioni	1,92
Prodotti chimici	1,64
Trasporto	1,60
Costruzione di macchine e apparecchi	1,41
Alberghi e ristoranti	1,29
Materiali per l'edilizia e commercio	1,27
Società immobiliari	1,09
Biotecnologie	0,86
Miniere di carbone e industria siderurgica	0,82
Tessile e abbigliamento	0,82
Metalli non ferrosi	0,78
Beni di consumo vari	0,66
Servizi di pubblica utilità	0,53
Arti grafiche ed editoria	0,41
Tabacco e bevande alcoliche	0,36
Servizi sanitari e sociali	0,36
Carta e prodotti forestali	0,31
Servizi vari	0,30
Fotografia e ottica	0,23
Metalli e pietre preziose	0,18
Pneumatici e gomma	0,13
Industria aeronautica e aerospaziale	0,10
Imballaggi	0,09
Agricoltura e pesca	0,06
Istituzioni non classificabili/non classificate	0,04
<b>Totale</b>	<b>98,93</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>1,07</b>

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di: **-fatturato** che riflette la quota di ricavi da attività green di società partecipate **-spese in conto capitale (CapEx)** che mostrano gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad esempio per la transizione verso un'economia green. **- spese operative (OpEx)**, per riflettere le attività operative green delle società partecipate.



## In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?

La quota degli investimenti del Comparto allineata con la Tassonomia UE è pari a 0%.

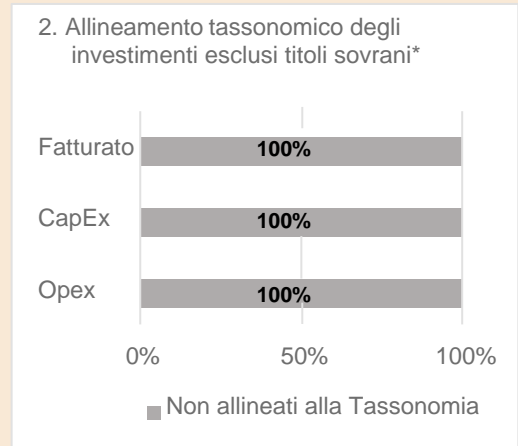
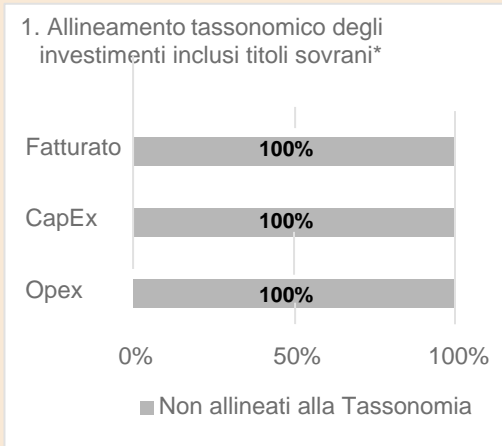
### ● Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE<sup>1</sup>?

Sì:  In gas fossile  In energia nucleare

No

<sup>1</sup>Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

**I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.**




*Dati non ancora disponibili*

\* Per le finalità di questi grafici, 'titoli sovrani' comprende tutte le esposizioni sovrane.

Le **Attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di contribuire in misura significativa a un obiettivo ambientale.

Le **Attività transitorie** sono attività per cui non sono ancora disponibili alternative a basso contenuto di carbonio e, tra altre, hanno livelli di emissioni di gas serra che corrispondono alla performance migliore.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE.

● **Qual è stata la percentuale di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**  
Per il periodo non erano disponibili dati affidabili riguardo alle attività transitorie e abilitanti.

● **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

L'esercizio finanziario 2022 è il primo per cui la Relazione periodica del Fondo viene fornita in linea con i modelli di reportistica introdotti dal Regolamento Delegato della Commissione (UE) 2022/1288 (SFDR-RTS). Il primo confronto sarà effettuato nella relazione periodica per l'esercizio 2023.



● **Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

La quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati alla tassonomia era pari al **28,04%** alla fine del periodo.

Ciò è dovuto al fatto che alcuni emittenti sono considerati investimenti sostenibili ai sensi del Regolamento SFDR ma hanno una porzione di attività che non sono allineate agli standard della tassonomia dell'UE, o per le quali non sono ancora disponibili dati per effettuare una valutazione in base alla Tassonomia dell'UE.



● **Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

La quota di investimenti socialmente sostenibili alla fine del periodo di riferimento era pari al 5,46%



● **Quali investimenti erano inclusi in "Altri", qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**

"2 Altri" include liquidità e altri strumenti detenuti con finalità di gestione della liquidità e del rischio di portafoglio. Può anche includere titoli privi di rating ESG per i quali non sono disponibili i dati necessari per la misurazione del raggiungimento di caratteristiche ambientali o sociali, ma ai quali si applicano esclusioni settoriali o normative.



● **Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Il quadro di analisi ESG di Amundi (disponibile online all'indirizzo: <https://www.amundi.lu/retail/Local-Content/Footer/Quick-Links/Regulatory-information/Amundi>) è stato predisposto per valutare la condotta aziendale in tre ambiti: Ambientale, Sociale e Governance (ESG). Amundi valuta l'esposizione delle società ai rischi e alle opportunità ESG, compresi i fattori e i rischi di sostenibilità, e il modo in cui le imprese gestiscono tali sfide in ciascuno dei rispettivi settori.

Per quanto riguarda gli emittenti di titoli quotati, Amundi assegna un punteggio a prescindere dal tipo di strumento, azionario o di debito.

Gli indicatori di sostenibilità del Comparto sono costantemente a disposizione nel sistema di gestione del portafoglio, consentendo ai gestori di portafoglio del Comparto di valutare l'impatto delle loro decisioni di investimento.

Questi indicatori sono integrati nel quadro di controllo di AMUNDI, con responsabilità ripartite tra il primo livello di controlli, svolti dai team di Investimento stessi, e il secondo livello di controlli eseguiti dai team Rischi, che monitorano la conformità alle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Fondo su base continuativa.

La politica di Investimento responsabile di AMUNDI definisce, inoltre, un approccio attivo di engagement, che promuove il dialogo con le società partecipate, incluse quelle presenti nel portafoglio di tale prodotto. La nostra Relazione annuale di Engagement, disponibile all'indirizzo <https://about.amundi.com/esg-documentation>, fornisce rapporti dettagliati su tale engagement e i suoi risultati.

Il quadro di analisi ESG di Amundi (disponibile online all'indirizzo: <https://www.amundi.lu/retail/Local-Content/Footer/Quick-Links/Regulatory-information/> Amundi) è stato predisposto per valutare la condotta aziendale in tre ambiti: Ambientale, Sociale e Governance (ESG). Amundi valuta l'esposizione delle società ai rischi e alle opportunità ESG, compresi i fattori e i rischi di sostenibilità, e il modo in cui le imprese gestiscono tali sfide in ciascuno dei loro settori. Per quanto riguarda gli emittenti di titoli quotati, Amundi assegna un punteggio a prescindere dal tipo di strumento, azionario o di debito.



## Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?

**I benchmark di riferimento** sono indici per misurare se il prodotto finanziario raggiunge le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

- ***In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?***

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?***

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?***

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e che le aziende partecipate seguano buone prassi di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche sostenibili dal punto di vista sociale. Sostenibile con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

**Nome del prodotto:**  
Onemarkets Amundi Flexible Income Fund

**Identificativo della persona giuridica (LEI):**  
529900ANIKKO9ZCAA439

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

**Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?**



**Sì**



**No**



Ha **effettuato investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale:**

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

Ha effettuato un **investimento sostenibile con un obiettivo sociale:** \_\_\_\_\_



Ha **promosso caratteristiche ambientali/sociali (E/S)** e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una percentuale del **24,88%** di investimenti sostenibili



in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**



**In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Il Comparto ha promosso caratteristiche ambientali e/o sociali rispettando il quadro di analisi ESG e la metodologia di scoring di Amundi, che include un insieme di approcci basati su esclusione, integrazione ESG e engagement.

Le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario sono incorporate nei criteri identificati per eseguire il quadro di analisi ESG.

Questi criteri sono differenti per le imprese che emettono strumenti quotati e per le entità sovrane.

Per gli emittenti corporate, la nostra analisi ESG è formata da 38 criteri, di cui 17 sono intersettoriali, comuni a tutte le imprese, a prescindere dal loro settore di attività, e 21 sono

criteri specifici per settore. Tali criteri sono stati ideati per valutare in che misura problematiche inerenti la sostenibilità possono influenzare l'emittente, nonché la qualità della gestione di questa dimensione. Sono stati considerati anche gli effetti sui fattori di sostenibilità, nonché la qualità delle attività di mitigazione intraprese. Tutti i criteri sono presenti nel sistema di gestione del portafoglio di front office dei gestori di fondi.

#### Criteri specifici per settore

##### Ambiente

- Energia pulita
- Auto ecologiche (green)
- Chimica green
- Edilizia sostenibile
- Gestione responsabile delle foreste
- Riciclo della carta
- Investimenti e finanziamenti green
- Assicurazioni green
- Green business
- Imballaggi

##### Sociali

- Bioetica
- Marketing responsabile
- Prodotto salutare
- Rischio del tabacco
- Sicurezza dei veicoli
- Sicurezza dei passeggeri
- Media responsabili
- Sicurezza dei dati e privacy
- Divario digitale
- Accesso alla medicina
- Inclusione finanziaria

#### Criteri intersettoriali

##### Ambiente

- Emissioni ed energia
- Gestione idrica
- Biodiversità e inquinamento
- Catena di approvvigionamento - Ambiente

##### Sociali

- Salute e sicurezza
- Condizioni di lavoro
- Relazioni sindacali
- Catena di approvvigionamento - Sociale 2
- Responsabilità di Prodotto e Cliente
- Coinvolgimento della comunità e Diritti umani

##### Governance

- Struttura del Consiglio di Amministrazione
- Audit e controllo
- Retribuzione
- Diritti degli azionisti
- Etica
- Pratiche fiscali
- Strategia ESG

La misura in cui questi criteri influenzano il punteggio ESG dell'emittente dipende dall'importanza relativa loro attribuita nel modello rispetto agli altri fattori considerati. Ogni emittente è stato valutato con un punteggio rapportato alla media del suo settore, al fine di distinguere tra migliori e peggiori prassi del settore.

Per quanto riguarda gli emittenti sovrani, la metodologia di Amundi si basa su una serie di circa 50 indicatori ESG. Tutti gli indicatori sono stati raggruppati in 8 categorie, ciascuna delle quali rientra in uno dei pilastri ESG. Parimenti alla nostra scala di rating ESG corporate, il punteggio ESG degli emittenti è convertito in un rating ESG compreso tra A e G:

##### Ambiente

- Cambiamento climatico
- Capitale naturale

##### Sociali

- Diritti umani
- Coesione sociale
- Capitale umano
- Diritti civili

##### Governance

- Efficacia delle azioni di governo
- Congiuntura economica

Non è stato stabilito alcun benchmark di riferimento per il conseguimento delle caratteristiche ambientali e sociali promosse.

#### Gli indicatori di sostenibilità

misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

#### ● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Amundi ha sviluppato internamente un processo di rating ESG proprietario basato sull'approccio "best in class".

Gli indicatori di sostenibilità impiegati per misurare il conseguimento delle caratteristiche ambientali o sociali sono stati il rating ESG assegnato a ciascun strumento finanziario secondo una metodologia proprietaria, il rating ESG del portafoglio risultante e il rating ESG del benchmark o dell'universo di investimento.

Riguardo al rating ESG, Amundi ha basato la propria analisi ESG delle imprese su un approccio "best-in-class". Ogni emittente è stato valutato con un punteggio quantitativo dimensionato sulla media del proprio settore, che ha consentito di distinguere le migliori prassi dalle peggiori a livello settoriale. La valutazione di Amundi si è basata su una combinazione di dati non finanziari provenienti da terzi e sull'analisi qualitativa dei temi settoriali e di sostenibilità associati. Il punteggio quantitativo si è tradotto in un rating, espresso mediante una lettera, su una scala compresa tra A (per le prassi migliori) e G (per le peggiori). Le società con rating G sono state escluse dagli investimenti di questo fondo. Il rating ESG di ogni emittente è ricavato dall'aggregazione dei rating relativi alle dimensioni ambientale, sociale e di corporate governance.

Il rating ESG complessivo del portafoglio è la media ponderata in base alla raccolta gestita (AuM) dei rating ESG di ogni emittente. Il Rating ESG del portafoglio deve essere superiore a quello del benchmark o dell'universo di investimento.

Al termine del periodo:

- Il rating ESG medio ponderato del portafoglio è pari a **0,73 (C)**
- Il rating ESG medio ponderato dell'indice di riferimento è pari a **0,00 (D)**

In aggiunta, Amundi ha applicato una politica di esclusione mirata relativamente agli emittenti che non rispettano la [Politica di investimento responsabile del Gruppo Amundi](#), ad esempio emittenti esposti alle regole e soglie di esclusione riportate nella nostra politica settoriale (ad es. carbone termico, tabacco), o che non rispettano le convenzioni e/o quadri riconosciuti a livello internazionale e le normative nazionali.

#### ● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

L'esercizio finanziario 2022 è il primo per cui la Relazione periodica del Fondo viene fornita in linea con i modelli di reportistica introdotti dal Regolamento Delegato della Commissione (UE) 2022/1288 (SFDR-RTS). Il primo confronto sarà effettuato nella relazione periodica per l'esercizio 2023.

#### ● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha parzialmente effettuato e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Gli investimenti sostenibili hanno come obiettivo investire in società partecipate che cercano di soddisfare due criteri:

1. aderire alle migliori prassi ambientali e sociali; ed
2. evitare la produzione di prodotti o la fornitura di servizi che danneggiano l'ambiente e la società.

Perché la società partecipata sia considerata un contributo all'obiettivo di cui sopra deve essere un "best performer" nel proprio settore di attività o riguardo ad almeno uno dei fattori ambientali o sociali significativi.

La definizione di "best performer" si basa sulla metodologia ESG proprietaria di Amundi, che mira a misurare la performance ESG di una società partecipata. Per essere considerata una "best performer", una società partecipata deve registrare una performance valutata con uno dei tre migliori rating (A, B o C su una scala di rating compresa tra A e G=, per almeno un fattore ambientale o sociale significativo. I fattori ambientali e sociali significativi sono identificati a livello settoriale. L'identificazione dei fattori significativi si basa sullo schema di analisi ESG di Amundi, che integra dati non finanziari e l'analisi qualitativa del settore e delle tematiche di sostenibilità associate. I fattori identificati come significativi contribuiscono per oltre il 10% al punteggio ESG complessivo. Per il settore energia, ad esempio, i fattori significativi sono: emissioni ed energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa di settori e fattori, si rimanda alla [Dichiarazione Regolativa di Amundi in materia ESG](#).

Per contribuire agli obiettivi di cui sopra, la società partecipata non dovrebbe avere un'esposizione significativa ad alcune attività non compatibili con questi criteri (ad esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carne, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso).

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello della società partecipata.

- ***In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato un danno significativo a qualsiasi obiettivo di investimento sostenibile ambientale e sociale?***

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino danni significativi ("DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori dei principali effetti negativi riportati nell'Allegato 1, Tabella 1 dell'RTS (ad es. PAI 3 Intensità dei gas serra delle società partecipate, PAI 13 Diversità del Consiglio di Amministrazione) mediante un insieme di indicatori (ad es. intensità di carbonio) e soglie o regole specifiche (ad es., l'intensità di carbonio della società partecipata non deve rientrare nell'ultimo decile del settore).

Amundi considera già alcuni Principali effetti negativi specifici nell'ambito della propria politica di esclusione come parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta alle prove illustrate sopra, riguardano i seguenti temi: esclusioni per armi controverse, violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite, carbone e tabacco.

Oltre ai fattori specifici di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non prende in considerazione gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi di cui sopra, al fine di verificare che l'impresa non abbia una performance carente dal punto di vista ambientale o sociale generale rispetto ad altre imprese del settore, e corrisponda così a un punteggio ambientale o sociale superiore o pari a E, utilizzando il rating ESG di Amundi.

- ***In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?***

Sono stati presi in considerazione tutti gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi per assicurare che gli investimenti sostenibili del Comparto non abbiano arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento ambientale o sociale.

Per **Principali effetti negativi** si intendono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e riguardanti il personale, rispetto dei diritti umani, questioni legate alla lotta alla corruzione e alla concussione.



Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi riportati nell'Allegato 1, Tabella 1 del Regolamento Delegato (UE) 2022/1288 mediante la combinazione dei seguenti indicatori e soglie o regole specifiche:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre imprese del settore (si applica solo a settori ad alta intensità), e
- avere un grado di diversità del Consiglio di Amministrazione che non si collochi nell'ultimo decile rispetto ad altre imprese del settore, e
- non avere in corso alcuna controversia relativa a condizioni di lavoro e diritti umani.
- non avere in corso alcuna controversia relativa a biodiversità e inquinamento.

Amundi considera già alcuni Principali effetti negativi specifici nell'ambito della propria politica di esclusione come parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta alle prove illustrate sopra, riguardano i seguenti temi: esclusioni per armi controverse, violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite, carbone e tabacco.

– ***Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:***

Gli investimenti sostenibili del Comparto erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani.

Le Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali e i Principi guida delle Nazioni Unite sono integrate nella nostra metodologia di scoring ESG. Il nostro strumento proprietario di rating ESG valuta gli emittenti utilizzando dati disponibili forniti dai nostri provider di dati. Il modello, ad esempio, include un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della comunità e Diritti umani" che si applica a tutti i settori in aggiunta agli altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di approvvigionamento socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Svolgiamo, inoltre, un'attività di monitoraggio delle controversie, a cadenza almeno trimestrale, che include le imprese individuate a causa di violazioni dei diritti umani. Quando si verificano delle controversie, gli analisti valutano la situazione e assegnano alla controversia un punteggio (impiegando la nostra metodologia proprietaria di scoring) e stabiliscono la migliore linea d'azione. I punteggi relativi alle controversie sono aggiornati trimestralmente per monitorarne l'andamento e gli sforzi di correzione.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi" (all'ambiente), in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e sono basati su criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



## In che modo il presente prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Il prodotto considera tutti i Principali effetti negativi obbligatori di cui all'Allegato 1, Tabella 1 del Regolamento Delegato (UE) 2022/1288 inerenti la strategia del prodotto e fa affidamento su una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali), approcci di engagement e voting:

- **Esclusione:** Amundi ha definito regole di esclusione sulla base di normative, tipologie di attività e settori che includono alcuni dei principali indicatori negativi di sostenibilità elencati nel Regolamento sulle disclosure (SFDR).
- **Integrazione di fattori ESG:** Amundi ha adottato standard minimi di integrazione ESG applicati per impostazione predefinita ai suoi fondi aperti gestiti attivamente (esclusione degli emittenti con rating G e punteggio ESG medio ponderato migliore più alto rispetto al benchmark applicabile). I 38 criteri utilizzati nell'approccio di valutazione ESG Amundi sono stati ideati anche per considerare i principali effetti sulla sostenibilità, nonché la qualità delle attività di mitigazione intraprese.
- **Engagement:** L'engagement o coinvolgimento è un processo continuo e mirato, finalizzato a influenzare le attività o il comportamento delle società partecipate. L'obiettivo delle attività di coinvolgimento può rientrare in due categorie: impegnare un emittente a migliorare la modalità di integrazione della dimensione ambientale e sociale; impegnare un emittente a migliorare il proprio impatto su aspetti ambientali, sociali, e relativi ai diritti umani o altrimenti attinenti alla sostenibilità, che rivestono un'importanza materiale per la società e l'economia globale.
- **Voto:** la politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutti gli aspetti a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, inclusi gli aspetti ESG rilevanti. Per maggiori informazioni, si rimanda alla Politica di voting di Amundi.
- **Monitoraggio delle controversie:** Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie basato su tre fornitori terzi di dati per monitorare in modo sistematico le controversie e il loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo è poi arricchito dalla valutazione approfondita di ogni controversia grave, diretta da analisti ESG e dall'esame periodico della sua evoluzione. Questo approccio si applica a tutti i fondi di Amundi.

INDICATORI RELATIVI AL CLIMA E AD ALTRI ASPETTI AMBIENTALI		
Indicatore negativo di sostenibilità		Azioni intraprese e programmate e target fissati per il prossimo periodo di riferimento
Emissioni di gas serra	1. Emissioni di gas serra (GHG)	Engagement Voting Integrazione di fattori ESG
	2. Impronta di carbonio	Engagement Voting Integrazione di fattori ESG
	3. Intensità dei gas serra delle società partecipate	Engagement Voting Integrazione di fattori ESG

	4. Esposizione verso imprese operanti nel settore dei combustibili fossili	Engagement Voting Esclusione
	5. Quota di consumi e produzione di energia non rinnovabile	Engagement Integrazione di fattori ESG
	6. Intensità del consumo energetico per settore ad alto impatto climatico	Engagement Integrazione di fattori ESG
Biodiversità	7. Attività che influenzano negativamente aree sensibili alla biodiversità	Engagement Voting Monitoraggio delle controversie Integrazione di fattori ESG
Acqua	8. Emissioni in acqua	Engagement Monitoraggio delle controversie Integrazione di fattori ESG
Rifiuti	9. Rapporto tra rifiuti pericolosi e rifiuti radioattivi	Engagement Monitoraggio delle controversie Integrazione di fattori ESG
INDICATORI SU ASPETTI SOCIALI E RELATIVI AI DIPENDENTI, RISPETTO DEI DIRITTI UMANI, LOTTA ALLA CORRUZIONE E ALLA CONCUSSIONE		
Aspetti sociali e relativi ai dipendenti	10. Violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite e delle Linee guida per le Imprese Multinazionali dell'Organizzazione per la Cooperazione e lo Sviluppo Economico (OCSE)	Engagement Voting Monitoraggio delle controversie Esclusione
	11. Mancanza di processi e meccanismi di compliance ai Principi del Global Compact delle Nazioni Unite e alle Linee Guida per le Imprese Multinazionali dell'OCSE	Engagement Voting Monitoraggio delle controversie
	12. Divario retributivo di genere non rettificato	Engagement Voting Monitoraggio delle controversie
	13. Diversità di genere nel Consiglio di Amministrazione	Engagement Voting
	14. Esposizione ad armi controverse (mine antiuomo, munizioni a grappolo, armi chimiche e armi biologiche)	Voting Esclusione

Indicatori applicabili a investimenti in titoli sovrani e sovranazionali		
Ambientali	15. Intensità GHG	<a href="#">Integrazione di fattori ESG</a>
Sociali	16. Paesi di investimento soggetti a violazioni sociali	<a href="#">Esclusione</a>



## Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la quota maggiore di investimenti del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento che è: **dal 01/07/2022 al 30/06/2023**

Maggiori investimenti	Settore	% Attività	Paese
AMUNDI PHYSICAL GOLD ETC (AMSTERDAM)	Fondi comuni	3,80%	IRL
DBR 1,7% 08/32	Titoli di Stato	2,72%	DEU
DBR 1% 8/25	Titoli di Stato	1,40%	DEU
BCEXUU UBS C(QMH)	Fondi comuni	1,33%	GBR
DBR 1,25% 8/48	Titoli di Stato	1,26%	DEU
DBR 1,8% 08/53	Titoli di Stato	1,25%	DEU
ISH CORE EUR CORP BOND UCITS EUR(LSE)	Fondi comuni	0,97%	IRL
OBL 0% 04/25 181	Titoli di Stato	0,97%	DEU
DBR 0% 02/32	Titoli di Stato	0,91%	DEU
BTP 7,25% 11/26	Titoli di Stato	0,86%	ITA
BTP 5% 03/25	Titoli di Stato	0,83%	ITA
OAT 5,50% 97- 04/29	Titoli di Stato	0,79%	FRA
DBR 0,5% 02/28	Titoli di Stato	0,76%	DEU
OBL 2,2% 04/28 187	Titoli di Stato	0,75%	DEU
US TSY 6,75% 08/26	Titoli di Stato	0,73%	USA

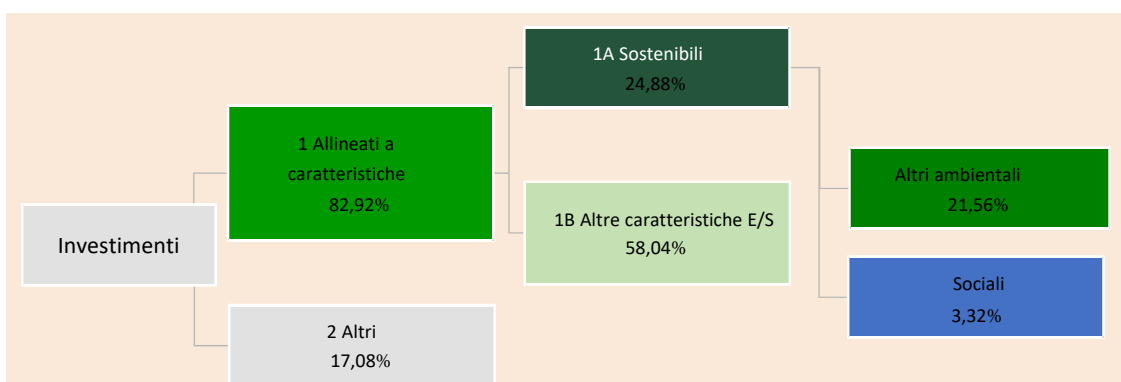


## Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?

### ● Qual è stata l'asset allocation?

Il Comparto ha investito il 24,88% delle sue attività in investimenti sostenibili. Di questi, lo 0% era allineato alla Tassonomia UE. Il 21,56% degli investimenti sostenibili sono considerati altri investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e il 3,32% investimenti socialmente sostenibili. Il 58,04% degli investimenti del Comparto sono utilizzati per raggiungere la caratteristica del Comparto durante il periodo di riferimento e non si qualificano come investimenti sostenibili.

Il 17,08% degli investimenti, ovvero la quota restante, non sono né investimenti sostenibili, né investimenti utilizzati per raggiungere le caratteristiche promosse dal Comparto.



L'**Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.

**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali e sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

La categoria **1 In linea con le caratteristiche E/S** comprende:

- La sottocategoria **1A Sostenibili** comprende investimenti sostenibili socialmente e dal punto di vista ambientale.
- La sottocategoria **1B Altre caratteristiche E/S** comprende investimenti in linea con le caratteristiche ambientali o sociali che non si qualificano come investimenti sostenibili.

● ***In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?***

<b>Settori / Sottosettori</b>	<b>% delle attività nette</b>
Obbligazioni di Stati, province e comuni	35,50
Holding e società finanziarie	11,63
Banche e altre istituzioni finanziarie	10,52
Servizi di pubblica utilità	3,44
Comunicazioni	3,20
Prodotti farmaceutici e cosmetici	3,11
Internet e servizi Internet	2,17
Petrolio	1,89
Trasporto	1,70
Cibi e bevande non alcoliche	1,69
Fondi di investimento	1,37
Prodotti chimici	1,30
Veicoli stradali	0,94
Forniture per ufficio e informatica	0,86
Industria aeronautica e aerospaziale	0,85
Ingegneria elettrica ed elettronica	0,81
Assicurazione	0,77
Elettronica e semiconduttori	0,76
Alberghi e ristoranti	0,76
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	0,73
Società immobiliari	0,70
Servizi vari	0,64
Tabacco e bevande alcoliche	0,62
Beni di consumo vari	0,62
Costruzione di macchine e apparecchi	0,43
Arti grafiche ed editoria	0,40
Imballaggi	0,36
Servizi sanitari e sociali	0,35
Tessile e abbigliamento	0,34
Materiali per l'edilizia e commercio	0,33
Metalli e pietre preziose	0,32
Pneumatici e gomma	0,19
Miniere di carbone e industria siderurgica	0,15
Biotecnologie	0,10
Agricoltura e pesca	0,09
Beni strumentali vari	0,05
Carta e prodotti forestali	0,04
Metalli non ferrosi	0,02
Servizi ambientali e riciclo	0,01
<b>Totale</b>	<b>89,76</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>10,24</b>



## In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?

La quota degli investimenti del Comparto allineata con la Tassonomia UE è pari a 0%.

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:  
- **fatturato** che riflette la quota di ricavi da attività green di società partecipate

- **spese in conto capitale (CapEx)** che mostrano gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad esempio per la transizione verso un'economia green.

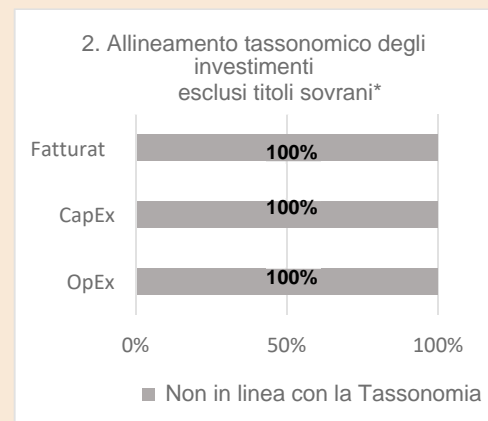
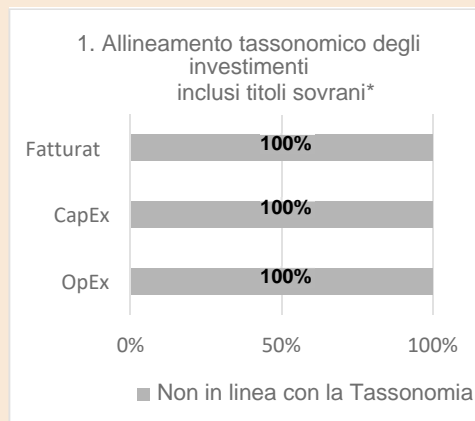
- **spese operative (OpEx)** che riflette le attività operative green delle società partecipate.

### Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE<sup>1</sup>?

Sì:  In gas fossile  In energia nucleare  
 No

<sup>1</sup>Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

**I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.**



\* Per le finalità di questi grafici, "titoli sovrani" comprende tutte le esposizioni sovrane.



Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di produrre un contributo sostanziale verso un obiettivo ambientale.

Le **attività transitorie** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basso contenuto di carbonio e, tra le altre, presentano livelli di emissioni di gas serra pari alle migliori prestazioni.



sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE.

### Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?

- Per il periodo non erano disponibili dati affidabili riguardo alle attività transitorie e abilitanti.
- **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

L'esercizio finanziario 2022 è il primo per cui la Relazione periodica del Fondo viene fornita in linea con i modelli di reportistica introdotti dal Regolamento Delegato della Commissione (UE) 2022/1288 (SFDR-RTS). Il primo confronto sarà effettuato nella relazione periodica per l'esercizio 2023.



### Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?

La quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la tassonomia era pari al **21,56%** alla fine del periodo.

Ciò è dovuto al fatto che alcuni emittenti sono considerati investimenti sostenibili ai sensi del Regolamento SFDR ma hanno una porzione di attività che non sono allineate agli standard della tassonomia dell'UE, o per le quali non sono ancora disponibili dati per effettuare una valutazione in base alla Tassonomia dell'UE.



### Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?

La quota di investimenti socialmente sostenibili alla fine del periodo di riferimento era pari al 3,32%



### Quali investimenti erano inclusi in "Altri", qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?

"2 Altri" include liquidità e altri strumenti detenuti con finalità di gestione della liquidità e del rischio di portafoglio. Può anche includere titoli privi di rating ESG per i quali non sono disponibili i dati necessari per la misurazione del raggiungimento di caratteristiche ambientali o sociali, ma ai quali si applicano esclusioni settoriali o normative.



## **Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Il quadro di analisi ESG di Amundi (disponibile online all'indirizzo: <https://www.amundi.lu/retail/Local-Content/Footer/Quick-Links/Regulatory-information/Amundi>) è stato predisposto per valutare la condotta aziendale in tre ambiti: Ambientale, Sociale e Governance (ESG). Amundi valuta l'esposizione delle società ai rischi e alle opportunità ESG, compresi i fattori e i rischi di sostenibilità, e il modo in cui le imprese gestiscono tali sfide in ciascuno dei loro settori. Per quanto riguarda gli emittenti di titoli quotati, Amundi assegna un punteggio a prescindere dal tipo di strumento, azionario o di debito.

Gli indicatori di sostenibilità del Comparto sono costantemente a disposizione nel sistema di gestione del portafoglio, consentendo ai gestori di portafoglio del Comparto di valutare l'impatto delle loro decisioni di investimento.

Questi indicatori sono integrati nel quadro di controllo di AMUNDI, con responsabilità ripartite tra il primo livello di controlli, svolti dai team di Investimento stessi, e il secondo livello di controlli eseguiti dai team Rischi, che monitorano la conformità alle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Fondo su base continuativa.

La politica di Investimento responsabile di AMUNDI definisce, inoltre, un approccio attivo di engagement, che promuove il dialogo con le società partecipate, incluse quelle presenti nel portafoglio di tale prodotto. La nostra Relazione annuale di Engagement, disponibile all'indirizzo <https://about.amundi.com/esg-documentation>, fornisce rapporti dettagliati su tale engagement e i suoi risultati.

Il quadro di analisi ESG di Amundi (disponibile online all'indirizzo: <https://www.amundi.lu/retail/Local-Content/Footer/Quick-Links/Regulatory-information/Amundi>) è stato predisposto per valutare la condotta aziendale in tre ambiti: Ambientale, Sociale e Governance (ESG). Amundi valuta l'esposizione delle società ai rischi e alle opportunità ESG, compresi i fattori e i rischi di sostenibilità, e il modo in cui le imprese gestiscono tali sfide in ciascuno dei loro settori. Per quanto riguarda gli emittenti di titoli quotati, Amundi assegna un punteggio a prescindere dal tipo di strumento, azionario o di debito.



## Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

I **benchmark di riferimento** sono indici per misurare se il prodotto finanziario raggiunge le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

- ***In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?***

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?***

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?***

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Questo prodotto non ha un benchmark ESG.

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

**Nome del prodotto:**  
Onemarkets Amundi Climate  
Focus Equity Fund

**Identificativo della persona giuridica (LEI):**  
529900S3XIZ72EHQKK37

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

### Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?

**Sì**

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale: \_\_\_%**

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia UE

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale: \_\_\_\_\_%**

**No**

Ha **promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)**e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del 71,61% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo sociale

Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**



### In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

Durante l'esercizio finanziario, il prodotto ha costantemente promosso caratteristiche ambientali e/o sociali:

- mirando ad avere un punteggio ESG superiore al punteggio ESG del proprio universo di investimenti, rappresentato da **MSCI WORLD**

**CLIMATE PARIS ALIGNED.** Per determinare il punteggio ESG del Prodotto e dell'universo di investimenti ESG, la performance ESG è stata costantemente monitorata mediante il confronto tra la performance media di un titolo rispetto al settore dell'emittente del titolo, relativamente a ciascuna delle tre caratteristiche ambientale, sociale e governance.

- mirando a ridurre la propria intensità carbonica mediante l'allineamento della propria impronta carbonica a quella del benchmark **MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED.**

### ● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

L'intensità dell'impronta di carbonio del portafoglio viene calcolata come media del portafoglio ponderata per gli asset e messa a confronto con l'intensità carbonica ponderata per gli asset del Benchmark. Di conseguenza, i titoli con un'impronta ambientale relativamente bassa avevano maggiore probabilità di essere selezionati nel portafoglio rispetto a titoli con un'impronta ambientale relativamente elevata.

- L'intensità media ponderata dell'impronta di carbonio del portafoglio è pari a 81,81 (tonnellate/ricavi in milioni di euro)
- L'intensità media ponderata dell'impronta di carbonio del Benchmark è pari a 89,62 (tonnellate/ricavi in milioni di euro)

Amundi ha sviluppato internamente un processo di rating ESG proprietario basato sull'approccio "best in class".

I rating adattati a ciascun settore di attività mirano a valutare le dinamiche nelle quali operano le aziende.

L'indicatore di sostenibilità impiegato è il punteggio ESG del Prodotto, che viene misurato rispetto al punteggio ESG dell'universo degli investimenti ESG del Prodotto.

Al termine del periodo:

- Il Rating ESG medio ponderato del portafoglio è pari a 0,66 (C)
- Il rating ESG medio ponderato dell'indice di riferimento è pari a 0,04 (D)

Il rating ESG di Amundi utilizzato per determinare il punteggio ESG è un punteggio ESG quantitativo convertito in sette gradi da A (punteggio migliore) a G (punteggio peggiore). Nella scala di rating ESG di Amundi, i titoli che fanno parte dell'elenco di esclusione corrispondono al rating G. Per quanto riguarda gli emittenti societari, le prestazioni ESG vengono valutate a livello globale e a livello di criteri rilevanti confrontandoli con le prestazioni medie del relativo settore rispetto alla combinazione delle tre dimensioni ESG:

- Dimensione ambientale: esamina la capacità degli emittenti di controllare il proprio impatto ambientale diretto e indiretto, limitando il consumo di energia, riducendo le emissioni di gas serra, lottando contro l'esaurimento delle risorse e proteggendo la biodiversità.
- Dimensione sociale: misura il modo in cui un emittente opera rispetto a due concetti distinti: la strategia dell'emittente per sviluppare il proprio capitale umano e il rispetto dei diritti umani in generale;
- Dimensione di governance: valuta la capacità dell'emittente di garantire le basi per un quadro di governance societaria efficace e di generare valore a lungo termine.

La metodologia applicata dal rating ESG di Amundi utilizza 38 criteri generici (comuni a tutte le società indipendentemente dalla loro attività) o specifici per settore, che sono ponderati in base al settore e considerati in termini di impatto sulla reputazione, sull'efficienza operativa e sulle normative relative a un emittente. I rating ESG di Amundi sono tendenzialmente espressi a livello globale rispetto alle tre dimensioni E, S e G o a livello individuale in merito a qualsiasi fattore ambientale o sociale.

#### ● ***... e rispetto ai periodi precedenti?***

L'esercizio finanziario 2022 è il primo per cui la Relazione periodica del Comparto viene fornita in linea con i modelli di reportistica introdotti dal Regolamento Delegato della Commissione (UE) 2022/1288 (SFDR-RTS). Il primo confronto sarà effettuato nella relazione periodica per l'esercizio 2023.

#### ● ***Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?***

Gli investimenti sostenibili hanno come obiettivo investire in società partecipate che cercano di soddisfare due criteri:

1. aderire alle migliori prassi ambientali e sociali; ed
2. evitare la produzione di prodotti o la fornitura di servizi che danneggiano l'ambiente e la società.

Perché la società partecipata sia considerata un contributo all'obiettivo di cui sopra deve essere un "best performer" nel proprio settore di attività o riguardo ad almeno uno dei fattori ambientali o sociali significativi.

La definizione di "best performer" si basa sulla metodologia ESG proprietaria di Amundi, che mira a misurare la performance ESG di una società partecipata. Per essere considerata una "best performer", una società partecipata deve registrare una performance valutata con uno dei tre migliori

rating (A, B o C su una scala di rating compresa tra A e G) nel proprio settore per almeno un fattore ambientale o sociale significativo. I fattori ambientali e sociali significativi sono identificati a livello settoriale. L'identificazione dei fattori significativi si basa sullo schema di analisi ESG di Amundi, che integra dati non finanziari e l'analisi qualitativa del settore e delle tematiche di sostenibilità associate. I fattori identificati come significativi contribuiscono per oltre il 10% al punteggio ESG complessivo. Per il settore energia, ad esempio, i fattori significativi sono: emissioni ed energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa dei settori e dei fattori, si rimanda alla Dichiarazione Regolativa ESG di Amundi disponibile nel sito [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu)

Per contribuire agli obiettivi di cui sopra, la società partecipata non dovrebbe avere un'esposizione significativa ad alcune attività non compatibili con questi criteri (ad esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carne, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso).

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello della società partecipata.

***In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o***

***sociale?***

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino danni significativi ("DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi riportati nell'Allegato 1, Tabella 1 dell'RTS (ad es. PAI Intensità dei gas serra della società partecipata) mediante una combinazione di indicatori (ad es. intensità carbonica) e soglie o regole specifiche (ad es. che l'intensità carbonica della società partecipata non si collochi nell'ultimo decile del settore).

Amundi considera già alcuni Principali effetti negativi specifici nell'ambito della propria politica di esclusione come parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta alle prove illustrate sopra, riguardano i seguenti temi: esclusioni per armi controverse, violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite, carbone e tabacco.

Oltre ai fattori specifici di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non prende in considerazione gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi di cui sopra, al fine di verificare che l'impresa non abbia una performance carente dal punto di vista ambientale o sociale generale rispetto ad altre imprese del settore, e corrisponda così a un punteggio ambientale o sociale superiore o pari a E, utilizzando il rating ESG di Amundi.

Per **Principali effetti negativi** si intendono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e riguardanti il personale, rispetto dei diritti umani, questioni legate alla lotta alla corruzione e alla concussione.

— — — *In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Sono stati presi in considerazione tutti gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi per assicurare che gli investimenti sostenibili del Comparto non abbiano arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento ambientale o sociale.

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori dei principali effetti negativi riportati nell'Allegato 1, Tabella 1 del Regolamento Delegato (UE) 2022/1288, ove siano disponibili dati solidi, attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e soglie o regole specifiche:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre imprese del settore (si applica solo a settori ad alta intensità), e
- avere un grado di diversità del Consiglio di Amministrazione che non si collochi nell'ultimo decile rispetto ad altre imprese del settore, e
- non avere in corso alcuna controversia relativa a condizioni di lavoro e diritti umani.
- non avere in corso alcuna controversia relativa a biodiversità e inquinamento.

Amundi considera già alcuni Principali effetti negativi specifici nell'ambito della propria politica di esclusione come parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta alle prove illustrate sopra, riguardano i seguenti temi: esclusioni per armi controverse, violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite, carbone e tabacco.

— — — *Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:*

Gli investimenti sostenibili del Comparto erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani.

Le Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali e i Principi guida delle Nazioni Unite sono integrate nella nostra metodologia di scoring ESG. Il nostro strumento proprietario di rating ESG valuta gli emittenti utilizzando dati disponibili forniti dai nostri provider di dati. Il modello, ad esempio, include un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della comunità e Diritti umani" che si applica a tutti i settori in aggiunta agli altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di approvvigionamento socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali.



Svolgiamo, inoltre, un'attività di monitoraggio delle controversie, a cadenza almeno trimestrale, che include le imprese individuate a causa di violazioni dei diritti umani. Quando si verificano delle controversie, gli analisti valutano la situazione e assegnano alla controversia un punteggio (impiegando la nostra metodologia proprietaria di scoring) e stabiliscono la migliore linea d'azione. I punteggi relativi alle controversie sono aggiornati trimestralmente per monitorarne l'andamento e gli sforzi di correzione.

### **In che modo il presente prodotto finanziario ha considerato i**

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario, che tengono conto dei criteri UE per le attività sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante porzione di questo prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per le attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



### **Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

Il prodotto considera tutti i Principali effetti negativi obbligatori di cui all'Allegato 1, Tabella 1 del Regolamento Delegato (UE) 2022/1288 inerenti la strategia del prodotto e fa affidamento su una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali), approcci di engagement e voting:

- **Esclusione:** Amundi ha definito regole di esclusione sulla base di normative, tipologie di attività e settori che includono alcuni dei principali indicatori negativi di sostenibilità elencati nel Regolamento sulle disclosure (SFDR).
- **Integrazione di fattori ESG:** Amundi ha adottato standard minimi di integrazione ESG applicati per impostazione predefinita ai suoi fondi aperti gestiti attivamente (esclusione degli emittenti con rating G e punteggio ESG medio ponderato migliore più alto rispetto al benchmark applicabile). I 38 criteri utilizzati nell'approccio di valutazione ESG Amundi sono stati ideati anche per considerare i principali effetti sulla sostenibilità, nonché la qualità delle attività di mitigazione intraprese.
- **Engagement:** L'engagement o coinvolgimento è un processo continuo e mirato, finalizzato a influenzare le attività o il comportamento delle società partecipate. L'obiettivo delle attività di coinvolgimento può rientrare in due categorie: impegnare un emittente a migliorare la modalità di integrazione della dimensione ambientale e sociale; impegnare un emittente a migliorare il proprio impatto su aspetti ambientali, sociali, e relativi ai diritti umani o altrimenti

attinenti alla sostenibilità, che rivestono un'importanza materiale per la società e l'economia globale.

- Voto: la politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutti gli aspetti a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, inclusi gli aspetti ESG rilevanti. Per maggiori informazioni, si rimanda alla Politica di voting di Amundi.
- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie basato su tre fornitori terzi di dati per monitorare in modo sistematico le controversie e il loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo è poi arricchito dalla valutazione approfondita di ogni controversia grave, diretta da analisti ESG e dall'esame periodico della sua evoluzione. Questo approccio si applica a tutti i fondi di Amundi.

Per ulteriori dettagli su come gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi vengono presi in considerazione, si rimanda alla Dichiarazione di Amundi sull'informativa sulla sostenibilità relativa ai settori finanziari, disponibile nel sito web [www.amundi.com](http://www.amundi.com).



## Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la quota maggiore di investimenti del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: dall'**1/07/2022** al **30/06/2023**

Maggiori investimenti	Settore	% Attività	Paese
MICROSOFT CORP	Information Technology	7,53%	USA
NVIDIA CORP	Information Technology	3,49%	USA
JPMORGAN CHASE & CO	Finanziari	2,99%	USA
MERCK & CO. INC.	Cura della salute	2,96%	USA
MASTERCARD INC-CL A	Finanziari	2,78%	USA
BROADCOM LTD	Information Technology	2,67%	USA
HOME DEPOT INC	Beni di consumo discrezionali	2,52%	USA
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	Beni di prima necessità	2,45%	GBR
TRANE TECHNOLOGIES PLC	Industriali	2,40%	IRL
SCHNEIDER ELECT SE	Industriali	2,34%	FRA
SONY CORP	Beni di consumo discrezionali	2,33%	JPN
NEXT PLC	Beni di consumo discrezionali	2,23%	GBR
DEERE & CO	Industriali	2,22%	USA
XYLEM INC	Industriali	2,21%	USA
ECOLAB INC	Materiali	2,18%	USA

## Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?

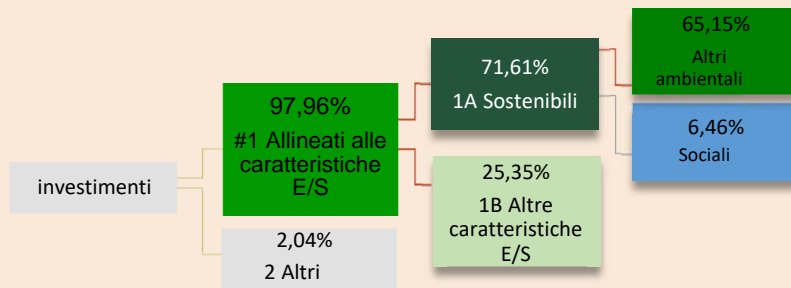
Il Comparto ha investito il 71,61% delle attività in investimenti sostenibili. Di questi, lo 0% era allineato alla Tassonomia UE. Il 65,15% degli investimenti sostenibili sono considerati altri investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e il 6,46% investimenti socialmente sostenibili. Il 97,96% degli investimenti del Comparto sono utilizzati per raggiungere la caratteristica del Comparto durante il periodo di riferimento e non si qualificano come investimenti sostenibili.

Il 2,04% degli investimenti, ovvero la quota restante, non sono né investimenti sostenibili, né investimenti utilizzati per raggiungere le caratteristiche promosse dal Comparto.



L'Asset allocation descrive la quota di investimenti in asset specifici.

### Qual è stata l'asset allocation?



**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati alle caratteristiche ambientali o sociali e non si qualificano come investimenti sostenibili.

La categoria **1 In linea con le caratteristiche E/S** comprende:

- La sottocategoria **1A Sostenibili** include gli investimenti sostenibili a livello ambientale e sociale.
- La sottocategoria **1B Altre caratteristiche E/S** comprende investimenti in linea con le caratteristiche ambientali o sociali che non si qualificano come investimenti sostenibili.

Per rispettare la Tassonomia UE, i criteri per il gas fossile includono limitazioni alle emissioni e il passaggio a energia completamente rinnovabile o a combustibili a basso contenuto di carbonio entro la fine del 2035. Per **l'energia nucleare**, i criteri comprendono regole complete per sicurezza e gestione dei rifiuti.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di produrre un contributo sostanziale verso un obiettivo ambientale.

Le **attività transitorie** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basso contenuto di carbonio e che, tra le altre, presentano livelli di emissioni di gas serra pari alle migliori prestazioni.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?**

<b>Settore</b>	<b>% Attività</b>
<i>Information Technology</i>	26,56%
<i>Industriali</i>	17,48%
<i>Finanziari</i>	15,60%
<i>Cura della salute</i>	12,32%
<i>Beni di consumo discrezionali</i>	11,40%
<i>Materiali</i>	5,07%
<i>Servizi di comunicazione</i>	4,15%
<i>Beni di prima necessità</i>	3,47%
<i>Immobiliare</i>	1,91%
<i>Servizi di pubblica utilità</i>	1,01%
<i>Cambi</i>	0,00%
<i>Liquidità</i>	1,02%



## In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?

La quota degli investimenti del Comparto allineata con la Tassonomia UE è pari a 0%.

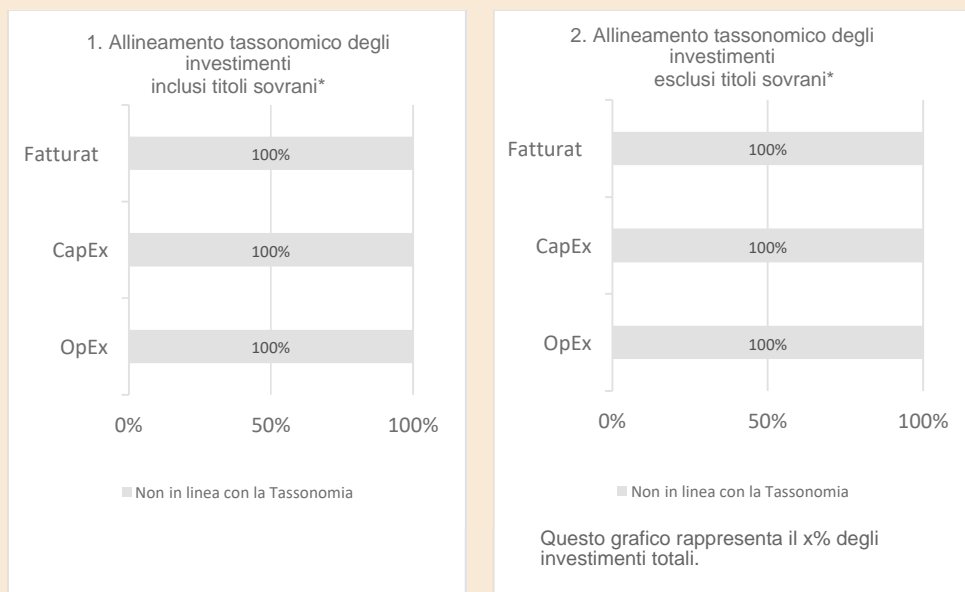
- Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE<sup>1</sup>?

Sì:

In gas fossile  In energia nucleare

No

***I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.***




\* Per le finalità di questi grafici, 'titoli sovrani' comprende tutte le esposizioni sovrane.

<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, che riflette la quota di ricavi di attività green delle società partecipate.
- **spese in conto capitale** (CapEx) che mostrano gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad esempio per la transizione verso un'economia green.
- **spese operative** (OpEx), che riflettono le attività operative green delle società partecipate.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale secondo il Regolamento (UE) 2020/852.

### ● **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Per il periodo di riferimento lo 0% degli investimenti del Comparto sono identificati, per le finalità della presente Relazione, come attività transitorie e abilitanti.

### ● **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

La quota degli investimenti del Fondo allineati con la Tassonomia UE è pari a 0%.

Si tratta del primo periodo di riferimento in cui il Comparto ha comunicato la quota degli investimenti in linea con la Tassonomia UE.



### **Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Al termine del periodo di riferimento la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non in linea con la Tassonomia UE era pari al 65,15%.

### **Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**



Al termine del periodo di riferimento la quota di investimenti socialmente sostenibili era pari al 6,46%.

### **Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**



“2 Altri” include liquidità e altri strumenti detenuti con finalità di gestione della liquidità e del rischio di portafoglio. Può anche includere titoli privi di rating ESG per i quali non sono disponibili i dati necessari per la misurazione del raggiungimento di caratteristiche ambientali o sociali, ma ai quali si applicano esclusioni settoriali e normative.

### **Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**



Gli indicatori di sostenibilità sono costantemente a disposizione nel sistema di gestione del portafoglio, consentendo ai gestori di portafoglio di valutare l'impatto delle loro decisioni di investimento.

Questi indicatori sono integrati nel quadro di controllo di AMUNDI, con responsabilità ripartite tra il primo livello di controlli, svolti dai team di

Investimento stessi, e il secondo livello di controlli eseguiti dai team Rischi, che monitorano la conformità alle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Fondo su base continuativa.

La politica di Investimento responsabile di AMUNDI definisce, inoltre, un approccio attivo di engagement, che promuove il dialogo con le società partecipate, incluse quelle presenti nel portafoglio di tale prodotto. La nostra Relazione annuale di Engagement, disponibile all'indirizzo <https://about.amundi.com/esg-documentation>, fornisce rapporti dettagliati su tale engagement e suoi risultati.



**I benchmark di riferimento** sono indici per misurare se il prodotto finanziario raggiunge le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

## **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

### **● *In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?***

Un indice di mercato generale non valuta né include i propri componenti sulla base di caratteristiche ambientali e pertanto non è allineato con caratteristiche ambientali.

L'indice impiegato è un "Paris Aligned Benchmark" che incorpora obiettivi specifici attinenti alla riduzione delle emissioni e alla transizione a un'economia a basso contenuto di carbonio attraverso la selezione e la ponderazione dei componenti sottostanti.

### **● *Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?***

- L'intensità media ponderata dell'impronta di carbonio del portafoglio è pari a 81,81 (tonnellate/ricavi in milioni di euro)

- L'intensità media ponderata dell'impronta di carbonio del Benchmark è pari a 89,62 (tonnellate/ricavi in milioni di euro)

### **● *Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?***

L'obiettivo di investimento sostenibile viene raggiunto allineando gli obiettivi di riduzione dell'impronta carbonica del Fondo con l'indice MSCI World Climate Paris Aligned Net USD. L'intensità dell'impronta di carbonio del portafoglio viene calcolata come media del portafoglio ponderata per gli asset e messa a confronto con l'intensità carbonica ponderata per gli asset dell'indice.

Di conseguenza, i titoli con impronte ambientali relativamente basse hanno maggiore probabilità di essere selezionati nel portafoglio rispetto a titoli con impronte ambientali relativamente elevate. In aggiunta, il Fondo esclude aziende in presenza di comportamenti controversi e (o) prodotti controversi in linea con la Politica di Investimento Responsabile.

- L'intensità media ponderata dell'impronta di carbonio del portafoglio è pari a 81,81 (tonnellate/ricavi in milioni di euro)
- L'intensità media ponderata dell'impronta di carbonio del Benchmark è pari a 89,62 (tonnellate/ricavi in milioni di euro)

● ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Questo è un prodotto a gestione attiva



**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

**Nome del prodotto:**  
onemarkets Fidelity World Equity Income Fund

**Identificativo della persona giuridica (LEI):**  
5299009COHSZRTC04M52

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?	
<p><input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <b>Sì</b></p> <p><input type="checkbox"/> Ha effettuato <b>investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale</b>: _____%</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE</li> <li><input type="checkbox"/> in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia UE</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> Ha effettuato <b>investimenti sostenibili con un obiettivo sociale</b>: _____%</p>	<p><input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>No</b></p> <p><input checked="" type="checkbox"/> Ha <b>promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)</b> e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del 62% di investimenti sostenibili</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> con un obiettivo sociale</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> Ha promosso caratteristiche E/S, ma <b>non ha effettuato investimenti sostenibili</b></p>



### In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto ha rispettato le caratteristiche ambientali e sociali che ha promosso, secondo quanto definito nell'informativa precontrattuale SFDR per il periodo in esame. Il Comparto ha promosso caratteristiche ambientali e sociali, investendo in titoli di emittenti con caratteristiche ESG positive. Le caratteristiche ESG positive sono determinate con riferimento ai rating ESG. I rating ESG hanno considerato caratteristiche ambientali, tra le quali intensità carbonica, emissioni carboniche,

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

efficienza energetica, gestione idrica e dei rifiuti, e biodiversità, oltre a caratteristiche sociali, tra le quali sicurezza di prodotto, catena di approvvigionamento, salute e sicurezza e diritti umani.

Il Fondo ha investito in investimenti sostenibili con obiettivi sociali, ciò ha contribuito agli obiettivi SDG a tema sociale come spiegato nella risposta sugli obiettivi degli investimenti sostenibili qui sotto.

Le cifre sugli investimenti sostenibili riportati nella presente informativa periodica sono al 30 giugno.

Limitazione dei Dati, può riguardare la disponibilità dei dati o difficoltà metodologiche. Fidelity continua a cercare fornitori alternativi di dati e mira a introdurre strumenti proprietari addizionali per contribuire a colmare le carenze di dati e fornire approfondimenti alternativi sulle prestazioni degli emittenti riguardo ad aspetti della sostenibilità. Inoltre, la limitazione dei dati è stata mitigata dal coinvolgimento degli emittenti e non ha avuto alcun impatto significativo sulla capacità del Comparto di raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse.

Non è stato stabilito alcun benchmark di riferimento per il conseguimento delle caratteristiche ambientali e sociali promosse.

#### ● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Il Comparto ha impiegato i seguenti indicatori di sostenibilità al fine di misurare il conseguimento delle caratteristiche ambientali o sociali che promuove:

1. la percentuale del Comparto investita in titoli di emittenti con caratteristiche ESG positive in linea con il Quadro per gli [investimenti sostenibili di Fidelity](#). Nell'applicare tale quadro durante il periodo di riferimento, il Gestore degli Investimenti ha considerato molti fattori, tra i quali l'approccio e le politiche di un emittente per affrontare il cambiamento climatico e la perdita di biodiversità, l'approccio all'efficienza energetica e alla gestione dei rifiuti e dell'inquinamento. Nel considerare la responsabilità sociale di un emittente, il Gestore degli investimenti ha cercato di capire le sue politiche di diversità, l'approccio verso i diritti umani e la gestione della catena di approvvigionamento, oltre all'approccio verso salute e sicurezza e welfare dei dipendenti. Il Gestore degli Investimenti ha inoltre analizzato il modo in cui un emittente gestisce la riservatezza dei dati e la sicurezza informatica sia all'interno del settore tecnologico che in linea generale negli altri settori. Tale analisi ESG si è avvalsa delle estese capacità di ricerca di Fidelity e sul continuo coinvolgimento degli emittenti, con il supporto dell'esperienza del team dedicato agli Investimenti Sostenibili, al fine di fornire una

valutazione prospettica della performance e della traiettoria di un emittente sugli aspetti della sostenibilità.

2. la percentuale del Comparto investita in titoli di emittenti societari con esposizione ai criteri di esclusione del Comparto
3. la percentuale del Comparto investita in investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale; e
4. la percentuale di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale.

La performance degli indicatori di sostenibilità utilizzati dal Comparto per misurare il raggiungimento delle caratteristiche sostenibili ambientali o sociali promosse durante il periodo in esame al 30 giugno 2023 era:

1. il 97% del mandato era investito in titoli di emittenti con caratteristiche ESG positive, in linea con il Quadro per gli Investimenti Sostenibili di Fidelity;
2. per quanto riguarda gli investimenti diretti in emittenti corporate, lo 0% del mandato era investito in titoli di emittenti con esposizione alle Esclusioni;
3. il 62% del mandato era investito in investimenti sostenibili;
4. il 24% del mandato era investito in investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale in attività economiche (che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia UE);
5. Il 38% del mandato era investito in investimenti sostenibili con un obiettivo sociale.

● ***... e rispetto ai periodi precedenti?***

L'esercizio finanziario 2022 è il primo per cui la Relazione periodica del Fondo viene fornita in linea con i modelli di reportistica introdotti dal Regolamento Delegato della Commissione (UE) 2022/1288 (SFDR-RTS). Il primo confronto sarà effettuato nella relazione periodica per l'esercizio 2023.

● ***Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?***

Pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, il Comparto aveva una quota del 62% di investimenti sostenibili. Il Comparto ha determinato un investimento sostenibile come segue:

1. emittenti che hanno intrapreso attività economiche che contribuiscono a uno o più obiettivi ambientali fissati nella Tassonomia UE e si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale in linea con la Tassonomia UE; o
2. emittenti dove la maggioranza dell'attività (oltre il 50% dei ricavi) ha contribuito a obiettivi ambientali o sociali, in linea con uno o più degli Obiettivi di Sviluppo Sostenibile (SDG) delle Nazioni Unite; o
3. emittenti che hanno fissato un obiettivo di decarbonizzazione coerente con uno scenario di riscaldamento globale pari a o inferiore a 1,5 gradi (verificato secondo la Science Based Target Initiative o un rating proprietario sul clima di Fidelity) che è stato considerato un contributo a obiettivi ambientali; a condizione che non arrechino danni significativi, soddisfino le garanzie minime e i criteri di buona governance.

***In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?***

Gli investimenti sostenibili sono stati selezionati per il coinvolgimento in attività che hanno arrecato danni significativi e controversie, valutati mediante Ciminimi che fanno riferimento ai Principali effetti negativi (PAI), nonché le performance riguardanti i parametri PAI. Ciò ha compreso:

1. selezioni basate sul rispetto delle norme - la selezione di titoli identificati nell'ambito degli attuali filtri basati sulle norme di Fidelity (come indicato di seguito);
2. Selezioni basate sull'attività- la selezione di emittenti sulla base della loro partecipazione ad attività con effetti negativi significativi sulla società o sull'ambiente, tra i quali emittenti giudicati coinvolti in una controversia molto grave utilizzando il filtro delle controversie, che comprende 1) questioni ambientali, 2) diritti umani e comunità, 3) diritti dei lavoratori e catena di approvvigionamento, 4) clienti, 5) governance; ed
3. indicatori PAI: dati quantitativi (ove disponibili) sugli indicatori PAI sono utilizzati per valutare se un emittente è coinvolto in attività che arrecano danni significativi a un qualsiasi obiettivo ambientale o sociale.

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

*In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Sono stati presi in considerazione tutti gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi per assicurare che gli investimenti sostenibili del Comparto non abbiano arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento ambientale o sociale.

Per gli investimenti sostenibili, come definiti sopra, Fidelity ha effettuato una valutazione quantitativa per identificare emittenti con performance difficili sul fronte degli indicatori PAI. Emittenti con un punteggio basso non sono giudicati idonei ad essere investimenti sostenibili, a meno che la ricerca fondamentale di Fidelity non abbia stabilito che l'azienda non sta violando i requisiti del principio del "non arrecare danni significativi" ed è avviata a mitigare gli effetti negativi attraverso un'efficace gestione o transizione.

*Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:*

Gli investimenti sostenibili del Comparto erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani.

Sono stati applicati filtri basati su norme. Emittenti il cui comportamento non è stato giudicato in linea con le loro responsabilità fondamentali in materia di diritti umani, lavoro, ambiente e lotta alla corruzione, ai sensi delle normative internazionali tra le quali quelle fissate dalle Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali e i Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti Umani, il Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC), le Convenzioni dell'Organizzazione Internazionale del Lavoro (OIL), non sono stati considerati investimenti sostenibili.

A questo fine emittenti che non rispettano i principi delle Linee Guida OCSE per le Imprese multinazionali e i Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti Umani sono esclusi dall'universo degli investimenti. Elenchi di tali società sono ottenuti da fornitori terzi, ad esempio MSCI, e periodicamente da Unicredit e vengono sistematicamente monitorati da sistemi di conformità pre-trade e continuativa.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



### **In che modo questo prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

I Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità sono stati considerati attentamente e incorporati nelle decisioni di investimento mediante una varietà di strumenti, tra i quali:

1. analisi di Due Diligence per valutare se i principali effetti negativi siano significativi.
2. rating ESG - Fidelity fa riferimento a rating ESG che incorporano i principali effetti negativi materiali, quali emissioni carboniche, sicurezza dei dipendenti e corruzione e concussione, gestione idrica. Per quanto riguarda i titoli sovrani, i Principali effetti negativi sono stati considerati attentamente e incorporati nelle decisioni di investimento impiegando rating che tengono conto dei Principali effetti negativi significativi quali emissioni di carbonio, violazioni sociali e libertà di espressione.
3. Esclusioni - Per gli investimenti diretti in emittenti societari, il Fondo ha applicato le Esclusioni (come definito di seguito) per contribuire a mitigare i PAI escludendo settori dannosi e vietando investimenti in emittenti che violano standard internazionali, quali lo UNGC. Riguardo ai propri investimenti diretti in emittenti societari il Mandato è soggetto a: (1) un elenco di esclusioni a livello aziendale, che include munizioni a grappolo e mine antiuomo, e (2) una selezione basata su norme di emittenti che il Responsabile degli investimenti valuta non abbiano operato in linea con le normative internazionali, incluso quanto stabilito dal UNGC. (3) la politica di esclusione del Gruppo UniCredit, secondo quanto descritto al paragrafo 1.14(f) e all'Allegato K del contratto di gestione degli investimenti stipulato tra Structured Invest S.A. e FIL (Luxembourg) S.A. l'1 agosto 2022 e operante dal 15 settembre 2022.

4. Le esclusioni e le selezioni di cui sopra (le "Esclusioni") possono essere occasionalmente aggiornate. Per ulteriori informazioni sul quadro degli investimenti sostenibili si rimanda al sito Internet ([fidelityinternational.com](http://fidelityinternational.com))
5. Engagement - Fidelity ha impiegato l'engagement come modo per comprendere meglio i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità e, in alcune circostanze, sostenere il miglioramento dei Principali effetti negativi e delle metriche in materia di sostenibilità. Fidelity ha preso parte a attività rilevanti di engagement individuali e collaborative centrate su una serie di Principali effetti negativi (ad es. Climate Action 100+, Investors Against Slavery e Trafficking APAC). I dettagli relativi all'approccio di engagement adottato da Fidelity sono disponibili nella [Politica di Engagement](#) di Fidelity.
6. Esercizio del diritto di voto (Voting) - La politica di voting di Fidelity ha incluso standard minimi espliciti relativi alla diversità di genere del Consiglio di Amministrazione e all'engagement a livello di cambiamento climatico. Fidelity può anche votare per migliorare la performance dell'emittente su altri indicatori. I dettagli riguardo all'esercizio dei diritti di voto da parte di Fidelity sono disponibili in [Principi e linee guida per l'esercizio dei diritti di voto negli Investimenti Sostenibili di Fidelity](#).

Nel valutare se gli investimenti abbiano avuto un Principale effetto negativo Fidelity ha tenuto conto di indicatori specifici per ciascun fattore di sostenibilità. Gli indicatori specifici presi in considerazione erano soggetti a disponibilità dei dati e potranno evolvere con il miglioramento della qualità e disponibilità dei dati. In alcune circostanze, quali investimenti indiretti effettuati dal mandato, i Principali effetti negativi possono non essere stati considerati.

INDICATORI RELATIVI AL CLIMA E AD ALTRI ASPETTI AMBIENTALI		
Indicatore negativo di sostenibilità		Azioni intraprese e programmate e target fissati per il prossimo periodo di riferimento
Emissioni di gas serra	1. Emissioni di gas serra (GHG)	Le valutazioni sul clima sono integrate nella ricerca tramite i nostri rating proprietari ESG, il rating proprietario sul clima e insiemi di dati di terzi (inclusa l'analisi di scenario).
	2. Impronta di carbonio	I rating ESG di Fidelity integrano esplicitamente i parametri PAI sul clima (tranne l'esposizione al settore dei combustibili fossili). I parametri sono selezionati per ciascun settore in base alla loro rilevanza.

	3. Intensità dei gas serra delle società partecipate	Il rating di Fidelity sul Clima completa i nostri rating ESG e valuta l'allineamento degli emittenti all'Accordo di Parigi e i percorsi Net Zero.
	4. Esposizione verso imprese operanti nel settore dei combustibili fossili	<p>Fidelity International ha fissato l'obiettivo di dimezzare entro il 2030 l'impronta carbonica aggregata dei nostri portafogli di investimento rispetto al 2020, a cominciare dalle partecipazioni azionarie e dalle obbligazioni societarie; e raggiungere quota Net Zero entro il 2050. Collaboriamo con le aziende riguardo ai nostri requisiti minimi sul clima relativi a:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Comunicazione dei dati sulle emissioni GHG Scope 1, 2 &amp; 3</li> <li>• Allineamento aziendale agli obiettivi dell'Accordo di Parigi</li> <li>• Informativa allineata con le raccomandazioni TCFD</li> <li>• Informativa dettagliata su rischi climatici e opportunità per il business</li> <li>• Avere una politica sul cambiamento climatico e un piano Net Zero in atto</li> </ul> <p>In aggiunta ai criteri minimi di cui sopra, abbiamo anche svolto attività tematiche di engagement con obiettivo di emissioni GHG Scope 2 pari a 1.587.899 tCO<sub>2</sub>e NA  Copertura: 86%  emissioni GHG Scope 355.592.853 tCO<sub>2</sub>e NA  Copertura: 86%  Totale emissioni GHG 63.300.020 tCO<sub>2</sub>e NA  Copertura: 86%</p> <p>2. Impronta carbonica Impronta carbonica 412 tCO<sub>2</sub>e per \$M USD Investiti NA  Copertura: 86%</p> <p>3. Intensità GHG delle società partecipate Intensità GHG delle società partecipate 759 tCO<sub>2</sub>e per \$M USD Ricavi NA  Copertura: 86%</p> <p>4. Esposizione verso imprese operanti nel settore dei combustibili fossili Quota di investimenti in società operanti nel settore dei combustibili</p>



		<p>fossili 6,23% NA Copertura: 74% Prestazione energetica</p> <p>5. Quota di consumi e produzione di energia non rinnovabile Quota di consumo di energia non rinnovabile e quota di produzione di energia non rinnovabile rispetto alla fonte di energia rinnovabile, espresse come percentuale delle fonti energetiche totali 46,4% NA Copertura: 61%</p> <p>6. Intensità dei consumi energetici per settore ad alto impatto Consumo di energia in GWh per milione di USD di ricavi delle società partecipate, per settore ad alto impatto sul clima A- Agricoltura, attività forestali e pesca: 0,0001 GWH per \$M USD di ricavi B- Minerario e cave: 0,0319 GWH per \$M USD Ricavi NA Copertura: 61% 7 Dichiarazione sui Principali effetti negativi C- Attività manifatturiera: 0,437 GWH per \$M USD di ricavi D- Fornitura di elettricità, gas, vapore e aria condizionata: 0,0772 GWH per \$M USD di ricavi E-Servizi di fornitura idrica, fognature, gestione dei rifiuti e bonifica: 0,005 GWH per \$M USD di ricavi F-Edilizia: 0,00168 GWH per \$M USD di ricavi G-Commercio all'ingrosso e al dettaglio, riparazione di veicoli a motore e motocicli: 0,00908 GWH per \$M USD di ricavi H-Trasporti e magazzino: 0,0212 GWH per \$M USD di ricavi L-Attività immobiliari: 0,00538 GWH per \$M USD di ricavi stimolando la decarbonizzazione del mondo reale. Per esempio, stiamo collaborando con società partecipate con esposizione al carbone termico per stimolarle a uscirne gradualmente.</p> <p><b>Voting</b> Ci aspettiamo che le nostre società partecipate:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Agiscano per gestire gli effetti del cambiamento climatico e ridurre le loro emissioni GHG.</li> </ul>
--	--	---

		<ul style="list-style-type: none"><li>• Forniscano informativa precisa e accurata riguardo a emissioni, target climatici, gestione e supervisione del rischio.</li></ul> <p>Laddove le aziende non rispettino le aspettative minime sul clima e non dimostrino la volontà o un piano per soddisfarle, voteremo contro il management.</p> <p>Collaborazione Appoggiamo i legislatori nell'aiutare i mercati a raggiungere target di riduzione delle emissioni allineati all'Accordo di Parigi. Contribuiamo regolarmente alle consultazioni pubbliche, incluse quelle riguardanti il Green Deal UE, il Piano d'Azione UE per la finanza sostenibile e l'informativa TCFD obbligatoria nel Regno Unito. Continuiamo a collaborare con i legislatori e fornire opinioni di esperti su tematiche riguardanti il finanziamento della transizione a basse emissioni di carbonio e il ruolo che la gestione patrimoniale può svolgere. Esclusioni Ai nostri fondi sostenibili si applicano esclusioni per miniere di carbone termico e produzione di energia, estrazione di sabbie bituminose e produzione di petrolio e gas artico. Ulteriori dettagli sul nostro approccio a considerare e mitigare gli effetti delle emissioni di gas serra e di altre emissioni si trovano nella nostra Politica sul Clima.</p>
--	--	--

	5. Quota di consumi e produzione di energia non rinnovabile	Si rimanda al precedente paragrafo 4
	6. Intensità del consumo energetico per settore ad alto impatto climatico	Si rimanda al precedente paragrafo 4
Biodiversità	7. Attività che influenzano negativamente aree sensibili alla biodiversità	<p><b>Approccio</b> Considerazioni sulla Biodiversità sono integrate nella nostra ricerca, che utilizza i nostri rating proprietari ESG che includono parametri relativi agli effetti sulla biodiversità terrestre e negli oceani. I parametri sono selezionati per ciascun settore in base alla loro rilevanza.</p> <p><b>Engagement e collaborazione</b> Fidelity International, insieme a più di altre 30 società finanziarie, si è impegnata a combattere le attività di deforestazione legate ad attività agricole a rischio forestale presso le aziende presenti nei nostri portafogli di investimento mediante engagement e stewardship entro la fine del 2025 sulla base del massimo impegno. Nel 2021 Fidelity International ha sottoscritto l'accordo Finance for Biodiversity, che si impegna a tutelare e ripristinare la biodiversità. L'iniziativa riunisce oltre 100 istituzioni finanziarie che si impegnano a collaborare e condividere conoscenze, attivarsi con altre aziende, valutare il proprio impatto e definire target di rendicontazione in materia di biodiversità entro il 2025. Fidelity International ha un programma di engagement tematico e collaborativo incentrato su questioni attinenti alla biodiversità. Le attività di engagement tematiche rilevanti comprendono: plastica, deforestazione e moda sostenibile.</p>

		<p><b>Esercizio del diritto di voto</b> Fidelity voterà contro gli amministratori, laddove essi non siano riusciti a gestire o implementare capacità atte a monitorare e valutare i rischi ambientali significativi relativi ad aspetti della biodiversità e ridurre l'impatto ecologico delle proprie operazioni</p>
Acqua	8. Emissioni in acqua	<p><b>Approccio</b> Considerazioni sulle emissioni in acqua, da rifiuti e materiali sono integrate nella nostra ricerca tramite i nostri rating ESG che includono parametri specifici su utilizzo dell'acqua, emissioni tossiche, e intensità dei rifiuti pericolosi. I parametri sono selezionati per ciascun settore in base alla loro rilevanza.</p> <p><b>Engagement e collaborazione</b> Fidelity è tra i firmatari dell'iniziativa Valuing Water Finance Initiative, che mira a sostenere le imprese verso una migliore gestione e tutela delle risorse idriche nelle loro operazioni aziendali e catene di approvvigionamento globali. Collaboriamo con emittenti con scarse prestazioni per aiutare a incoraggiare migliorie a tutela delle risorse idriche. Inoltre, cercheremo di impegnarci con emittenti che non hanno un'incidenza elevata di rifiuti pericolosi.</p> <p><b>Esercizio del diritto di voto</b> Fidelity International vota contro gli amministratori laddove un'azienda non sia riuscita a gestire adeguatamente l'approvvigionamento idrico, non abbia intrapreso un'azione di mitigazione dei potenziali rischi di carenza idrica, o essi siano responsabili di mancanze che hanno prodotto significativo inquinamento o contaminazione.</p>

Rifiuti	9. Rapporto tra rifiuti pericolosi e rifiuti radioattivi	Si rimanda al paragrafo precedente 8
INDICATORI SU ASPETTI SOCIALI E RELATIVI AI DIPENDENTI, RISPETTO DEI DIRITTI UMANI, LOTTA ALLA CORRUZIONE E ALLA CONCUSSIONE		
Aspetti sociali e relativi ai dipendenti	10. Violazione dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite e delle Linee guida per le Imprese Multinazionali dell'Organizzazione per la Cooperazione e lo Sviluppo Economico (OCSE)	<p><b>Approccio</b> Considerazioni su Corporate governance e Diritti umani sono integrate nella ricerca mediante i nostri rating ESG proprietari, che comprendono indicatori su diritti umani, schiavitù moderna e questioni relative alla lotta alla corruzione e alla concussione. I parametri sono selezionati per ciascun settore in base alla loro rilevanza.</p> <p><b>Esclusioni</b> Fidelity International esclude emittenti che ritiene violino il Global Compact delle Nazioni Unite, le Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali, i Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani, Responsible Business Conduct e le Convenzioni dell'Organizzazione Internazionale del Lavoro (OIL). Engagement e collaborazione Fidelity International è membro della Investors Against Slavery and Trafficking Asia Pacific initiative e mira a guidare un cambiamento positivo attraverso attività di engagement collaborativo con aziende mirate.</p> <p><b>Esercizio del diritto di voto</b> Fidelity International voterà contro l'elezione di membri del Consiglio di Amministrazione di una società, laddove a suo giudizio l'azienda non abbia soddisfatto gli standard minimi di monitoraggio e supervisione sull'azienda stessa e sui suoi fornitori riguardo ai diritti umani e alla</p>

		riduzione al minimo del rischio di schiavitù moderna o di violazioni dei diritti umani all'interno dell'organizzazione o della catena di approvvigionamento.
	11. Mancanza di processi e meccanismi di compliance ai Principi del Global Compact delle Nazioni Unite e alle Linee Guida per le Imprese Multinazionali dell'OCSE	<a href="#">Si rimanda al paragrafo precedente (10)</a>
	12. Divario retributivo di genere non rettificato	<p><b>Approccio</b> Considerazioni sul divario retributivo di genere e la diversità di genere del Consiglio di Amministrazione sono integrate nella nostra ricerca tramite il nostro rating ESG proprietario attraverso l'inclusione di indicatori specifici. I parametri sono selezionati per ciascun settore in base alla loro rilevanza.</p> <p><b>Engagement e collaborazione</b> Fidelity International supporta varie iniziative a livello globale relative al divario retributivo di genere e alla diversità, quali la campagna 30% Club e la Vision 40:40, che mirano a creare team executive equilibrati per genere entro il 2030. <b>Esercizio del diritto di voto</b> La nostra politica di voting è concepita per incoraggiare la diversità di genere nei Consigli aziendali. Supportiamo la diversità di genere nei Consigli di Amministrazione delle aziende e voteremo contro l'elezione di amministratori, laddove i Consigli non abbiano almeno il 30% di rappresentanza femminile nelle aziende dei mercati maggiormente sviluppati (quali Regno Unito, UE, USA e Australia) e il 15% in tutti gli altri mercati, dove gli standard sulla diversità di genere sono ancora in fase di sviluppo. Possiamo anche tenere conto di fattori quali la dimensione del consiglio di amministrazione, il settore e la struttura societaria.</p>

		<p><b>Esclusioni</b> Escludiamo emittenti con esposizione ad armi controverse, in conformità alla nostra Politica di esclusione.</p> <p>Alla nostra famiglia di Fondi sostenibili si applicano ulteriori esclusioni, quali produttori di armi semiautomatiche e convenzionali.</p>
	13. Diversità di genere nel Consiglio di Amministrazione	Si rimanda al paragrafo precedente 12
	14. Esposizione ad armi controverse (mine antiuomo, munizioni a grappolo, armi chimiche e armi biologiche)	Si rimanda al paragrafo precedente 12
Indicatori applicabili a investimenti in titoli sovrani e sovranazionali		
Ambientali	15. Intensità GHG	<p><b>Approccio</b> Fidelity International è in attesa del completamento di uno standard globale per l'intensità dei gas serra derivanti da investimenti in titoli sovrani a cura della Partnership for Carbon Accounting Financials (PCAF) e intende adottare lo standard globale non appena disponibile. <b>Esclusioni</b> La famiglia dei Fondi sostenibili di Fidelity International esclude titoli sovrani sulla base di: 1) una valutazione internazionale di tre principi relativi a governance, rispetto dei diritti umani e politica estera; e 2) indicatori di Paese esterni riconosciuti a livello internazionale.</p>
Sociali	16. Paesi di investimento soggetti a violazioni sociali	Si rimanda al paragrafo precedente 15



## Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?

<b>Maggiori investimenti</b>	<b>Settore</b>	<b>% Attività</b>	<b>Paese</b>
Progressive Corp. Ohio	Finanziari	5,18	USA
Marsh & McLennan Cos Inc	Finanziari	4,88	USA
Deutsche Boerse AG	Finanziari	4,86	Germania
Unilever PLC	Beni di prima necessità	4,78	UK
RELX PLC	Industriali	4,64	UK
Wolters Kluwer NV	Industriali	4,25	Paesi Bassi
Amdocs LTD	Information Technology	3,91	Guernsey
Iberdrola SA	Servizi di pubblica utilità	3,89	Spagna
Munich Reinsurance (REG)	Finanziari	3,58	Germania
Sanofi	Cura della salute	3,56	Francia
Cisco Systems Inc	Information Technology	3,54	USA
Roche Holdings AG (Buoni di godimento)	Cura della salute	3,39	Svizzera
Linde PLC	Materiali	3,14	Irlanda
CME Group Inc CL A	Finanziari	3,12	USA
WW Grainger Inc	Industriali	2,92	USA



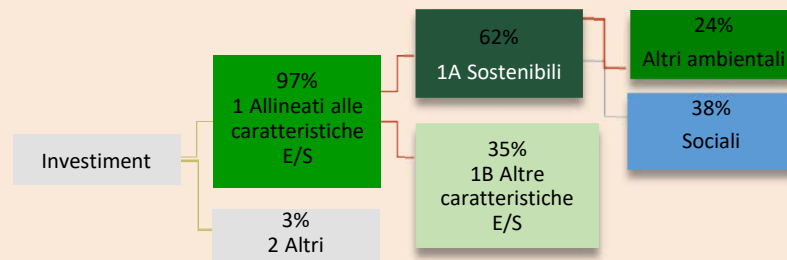
## Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?

Il Comparto ha investito il 62% delle proprie attività in investimenti sostenibili. Di questi, lo 0% era allineato alla Tassonomia UE. Il 24% degli investimenti sostenibili sono considerati altri investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e il 38% investimenti socialmente sostenibili. Il 35% degli investimenti del Comparto è utilizzato per raggiungere la caratteristica promossa del Comparto durante il periodo di riferimento e non si qualificano come investimenti sostenibili. Il 3% degli investimenti, ovvero la quota restante, non rappresenta né investimenti sostenibili né investimenti utilizzati per raggiungere le caratteristiche promosse dal Fondo.



### ● Qual è stata l'asset allocation?

**L'Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.



**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali e sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

La categoria **1 In linea con le caratteristiche E/S** comprende:

- La sottocategoria **1A Sostenibili** comprende investimenti sostenibili socialmente e dal punto di vista ambientale.
- La sottocategoria **1B Altre caratteristiche E/S** comprende investimenti in linea con le caratteristiche ambientali o sociali che non si qualificano come investimenti sostenibili.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?**

I settori economici degli investimenti effettuati durante il periodo in esame sono stati:

Per rispettare la Tassonomia UE, i criteri per il gas fossile includono limitazioni alle emissioni e il passaggio a energia completamente rinnovabile o a combustibili a basso contenuto di carbonio entro la fine del 2035. Per l'**energia nucleare**, i criteri comprendono regole complete per sicurezza e gestione dei rifiuti.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di produrre un contributo sostanziale verso un obiettivo ambientale.

Le **attività transitorie** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basso contenuto di carbonio e che, tra le altre, presentano livelli di emissioni di gas serra pari alle migliori prestazioni.

<b>Settore / Sottosettori</b>	<b>% delle attività nette</b>
Holding e società finanziarie	19,28
Assicurazione	18,91
Arti grafiche ed editoria	11,32
Ingegneria elettrica ed elettronica	7,78
Prodotti farmaceutici e cosmetici	5,06
Elettronica e semiconduttori	5,02
Internet e servizi Internet	4,80
Cibi e bevande non alcoliche	4,78
Servizi di pubblica utilità	3,89
Forniture per ufficio e informatica	3,54
Costruzione di macchine e apparecchi	2,81
Comunicazioni	2,34
Pneumatici e gomma	2,19
Prodotti chimici	2,02
Beni di consumo vari	1,93
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	1,40
Banche e altre istituzioni finanziarie	0,84
<b>Totale</b>	<b>97,91</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>2,09</b>

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, che riflette la quota di ricavi di attività green delle società partecipate.
- **spese in conto capitale (CapEx)** che mostrano gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad esempio per la transizione verso un'economia green.
- **spese operative (OpEx)**, che riflettono le attività operative green delle società partecipate.



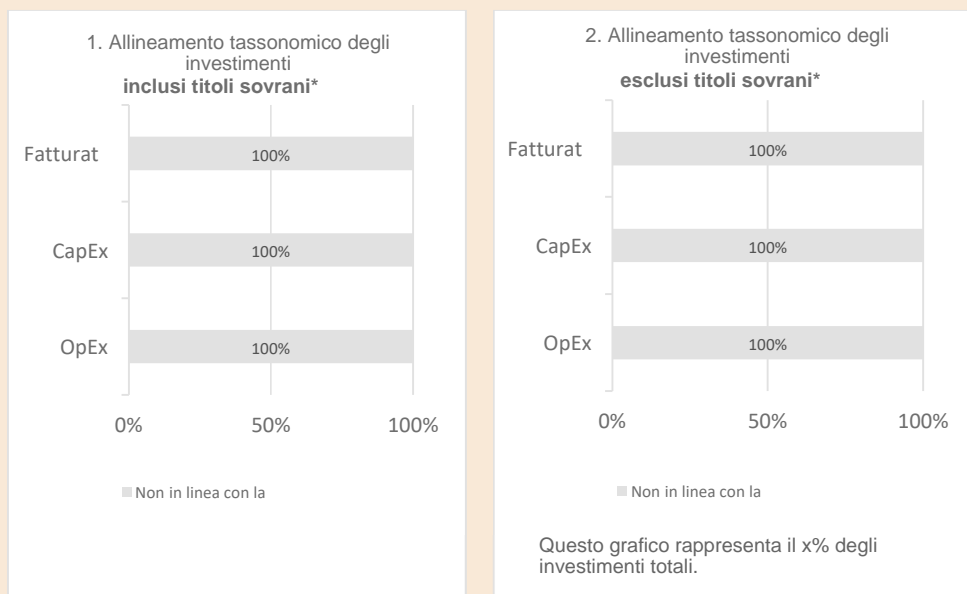
## In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?

La quota degli investimenti del Comparto allineata con la Tassonomia UE è pari a 0%.

### Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE<sup>1</sup>?

- Sì:
   
 In gas fossile     In energia nucleare
   
 No

*I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.*



\* Per le finalità di questi grafici, 'titoli sovrani' comprende tutte le esposizioni sovrane.

<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

● **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Non applicabile

● **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

Non applicabile



sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale secondo il Regolamento (UE) 2020/852.



**Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Al termine del periodo di riferimento la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non in linea con la Tassonomia UE era pari al 24%.

Il Responsabile degli Investimenti ha definito la propria metodologia per la determinazione degli investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale, che si basa sugli Obiettivi di Sviluppo Sostenibile delle Nazioni Unite (SDG) a contenuto ambientale.



**Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

Al termine del periodo di riferimento la quota di investimenti socialmente sostenibili era pari al 38%.



**Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele minime ambientali o sociali?**

La restante parte degli investimenti del Comparto è stata investita in titoli di emittenti in grado di dimostrare di essere in una traiettoria di miglioramento riguardo alle loro caratteristiche ESG, oltre che in liquidità e disponibilità liquide equivalenti con finalità di gestione della liquidità e in derivati, che sono stati utilizzati per investimento e una gestione efficace del portafoglio. Come tutela minima ambientale e sociale, il Comparto ha aderito alle esclusioni.



**Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Il nostro quadro di rating ESG proprietari, oltre all'accesso a fornitori esterni di dati ESG e agenzie di rating, ci ha consentito di valutare le caratteristiche delle partecipazioni del Comparto nel corso del periodo e tenere in considerazione i Principali effetti negativi. Viene inoltre valutato in che misura gli emittenti di questi titoli rispettano le nostre aspettative riguardo alle migliori prassi.

Inoltre, il Comparto è sottoposto a un'Analisi di Sostenibilità trimestrale, che alimenta un forum di discussione sulle caratteristiche ESG qualitative e quantitative del Comparto e se esse siano in linea con i requisiti e con le aspettative del cliente. Si tratta di un'estensione dei processi pre-esistenti del Comparto riguardanti rischi e compliance. Laddove opportuno, il Responsabile degli investimenti del Comparto ha utilizzato la propria sfera di influenza sulle imprese mediante [attività di engagement e stewardship attive](#).



I **benchmark di riferimento** sono indici per misurare se il prodotto finanziario raggiunge le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

### **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile. Il Comparto non ha indicato un indice come benchmark di riferimento per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Comparto.

- ***In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?***  
Non applicabile
- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?***  
Non applicabile
- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?***  
Non applicabile
- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***  
Non applicabile

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

**Nome del prodotto:**  
onemarkets BlackRock Global Equity Dynamic Opportunities Fund

**Identificativo della persona giuridica (LEI):**  
529900HZH9S0OBUCKK86

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

**Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?** *[spunta e compila, se pertinente, la cifra percentuale rappresenta gli investimenti sostenibili]*

**Sì**

**No**

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale:** \_\_\_%

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale:** \_\_\_\_\_%

Ha **promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)**e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del 54,6% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia UE

con un obiettivo sociale

Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**



Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

### In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

La tabella seguente elenca le caratteristiche ambientali e sociali che sono state promosse dal Comparto durante il periodo di riferimento. Ulteriori informazioni su queste caratteristiche ambientali e sociali sono contenute nel prospetto del Comparto. Si rimanda alla sezione di seguito "Qual è stato l'andamento degli indicatori"

di sostenibilità?", che fornisce informazioni sulla misura in cui il Comparto ha conseguito tali caratteristiche ambientali e sociali.

Caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Fondo
<p>Esclusione di emittenti a cui si valuta siano associate esternalità negative, quali, a titolo esemplificativo ma non esaustivo:</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. la produzione di alcuni tipi di armi controverse</li><li>2. la distribuzione o produzione di armi da fuoco o munizioni per armi leggere destinate al commercio al dettaglio ad uso civile</li><li>3. l'estrazione di alcuni tipi di combustibili fossili e/o la generazione di energia da essi</li><li>4. la produzione di prodotti del tabacco o alcune attività relative a prodotti del tabacco; ed</li><li>5. emittenti che si ritiene non abbiano rispettato i principi del Global Compact delle Nazioni Unite</li><li>6. emittenti coinvolti nella proprietà o nell'esercizio di attività o strutture legate al gioco d'azzardo</li><li>7. attività di produzione, fornitura ed estrazione legate all'energia nucleare</li><li>8. produzione di materiali di intrattenimento per adulti, e</li><li>9. aziende inserite nell'elenco People for the Ethical Treatment of Animals (PETA) delle strutture che producono prodotti testati sugli animali, oltre a marchi che sono di proprietà di società che non hanno adottato una politica permanente di test che non prevedono il coinvolgimento di animali.</li></ol>
<p>L'aderenza alla politica di esclusione di UniCredit con criteri di esclusione che identificano aziende e/o Paesi e/o sottostanti in cui non si dovrebbe effettuare investimenti o in cui eventuali investimenti dovrebbero rispettare soglie predefinite:</p> <ol style="list-style-type: none"><li>10. Aziende coinvolte in gravi violazioni del Global Compact delle Nazioni Unite</li><li>11. Aziende che producono, effettuano manutenzione o commerciano armi controverse e/o moralmente non accettabili, identificate come tali attraverso impegni, trattati e legislazioni internazionali.</li><li>12. Aziende coinvolte nella produzione di carbone termico e/o nella produzione di energia da carbone termico, che derivano da tali attività oltre il 10% dei loro ricavi consolidati. Si richiede inoltre l'uscita obbligatoria entro il 2028.</li><li>13. Aziende coinvolte nella produzione di combustibili controversi e aziende che estraggono idrocarburi con tecniche discutibili o in aree ad elevato impatto ambientale.</li><li>14. Aziende coinvolte nella produzione del tabacco che derivano da tali attività oltre il 5% dei loro ricavi consolidati.</li><li>15. Aziende coinvolte nella produzione di energia nucleare che derivano da tali attività oltre il 15% dei loro ricavi consolidati.</li><li>16. Aziende coinvolte nella produzione di armi che derivano da tali attività oltre il 10% dei loro ricavi consolidati.</li><li>17. Aziende coinvolte nel business del gioco d'azzardo che derivano da tali attività oltre il 15% dei loro ricavi consolidati.</li><li>18. Aziende coinvolte nel business dell'intrattenimento degli adulti che derivano da tali attività oltre il 15% dei loro ricavi consolidati.</li></ol>
<p>Il Comparto cerca di escludere/restringere in misura significativa gli investimenti in aziende che non hanno rispettato gli standard ESG minimi, eliminando dalla propria considerazione il 20% inferiore dei titoli inclusi nel proprio indice di riferimento (MSCI ACWI) in base al rating MSCI.</p>
<p>Il Consulente per gli Investimenti cercherà di migliorare l'esposizione ad investimenti che si ritiene siano associati ad esternalità positive.</p>
<p>Il Comparto investe una quota minima del 20% in Investimenti Sostenibili ai sensi dell'articolo 2(17) SFDR. Il Gestore degli investimenti definisce Investimenti sostenibili gli investimenti che contribuiscono a una serie di obiettivi ambientali e/o sociali che possono includere, a titolo esemplificativo ma non esaustivo, energia alternativa e rinnovabile, efficienza energetica, prevenzione o mitigazione dell'inquinamento, riutilizzo e riciclo, salute, alimentazione, servizi igienici e istruzione e gli Obiettivi di sviluppo sostenibile delle Nazioni Unite ("Obiettivi ambientali e sociali").</p>
<p>Il Comparto mira a raggiungere una riduzione del punteggio sull'intensità delle emissioni carboniche rispetto all'Indice.</p>

● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

La tabella seguente fornisce informazioni sull'andamento degli Indicatori di Sostenibilità utilizzati per misurare il raggiungimento di ciascuna delle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto, come ulteriormente dettagliato nel prospetto del Comparto.

Tutti gli indicatori sono calcolati come medie trimestrali dall'avvio del Comparto il 30 settembre 2022 alla fine dell'esercizio il 30 giugno 2023.

<b>Indicatore di Sostenibilità</b>	<b>Parametro</b>	<b>Andamento nel periodo di riferimento</b>
Esclusione di emittenti sulla base dei criteri di esclusione definiti nella tabella riportata sopra "Caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Fondo"	# di violazioni attive rilevate	1 violazione attiva rilevata.
Migliorare l'esposizione a investimenti che si ritiene siano associati ad esternalità positive.	Quota di investimenti con esternalità positive del >50%	Il Comparto ha raggiunto una quota del 72,1% di esternalità positive
Investimenti con esternalità positive in Investimenti Sostenibili ai sensi dell'articolo 2(17) SFDR	Quota minima del 20%	Il Comparto ha raggiunto una quota del 54,6% di Investimenti Sostenibili
Riduzione del punteggio sull'intensità delle emissioni di carbonio rispetto all'Indice.	Intensità delle emissioni (scope 1 & 2, normalizzate per le vendite (t per milione di USD di vendite)) rispetto all'indice di riferimento del Fondo	Il Comparto ha raggiunto una riduzione del 34,5% dell'intensità delle emissioni Scope 1 & 2 normalizzate per le vendite. (Fondo 91,08, Indice: 139,23)

● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

L'esercizio finanziario 2022 è il primo per cui la Relazione periodica del Comparto viene fornita in linea con i modelli di reportistica introdotti dal Regolamento Delegato della Commissione (UE) 2022/1288 (SFDR-RTS). Il primo confronto sarà effettuato nella relazione periodica per l'esercizio 2023.

● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Il presente Comparto ha investito almeno il 20% delle proprie partecipazioni in Investimenti Sostenibili ai sensi dell'articolo 2(17) SFDR. Tutti gli Investimenti Sostenibili sono valutati dal Responsabile degli Investimenti conformi allo standard DNSH del Responsabile degli Investimenti illustrato di seguito.

Il Gestore degli investimenti ha investito in Investimenti sostenibili che hanno contribuito a una serie di obiettivi ambientali e/o sociali che possono includere, a titolo esemplificativo ma non esaustivo, energia alternativa e rinnovabile, efficienza energetica, prevenzione o mitigazione



dell'inquinamento, riutilizzo e riciclo, salute, alimentazione, servizi igienici e istruzione e gli Obiettivi di sviluppo sostenibile delle Nazioni Unite ("Obiettivi ambientali e sociali").

Si valuta che un investimento sostenibile contribuisca a un obiettivo ambientale o sociale laddove:

1. una minima percentuale dell'attività aziendale dell'emittente contribuisce a un obiettivo ambientale e/o sociale; o
2. le prassi aziendali dell'emittente contribuiscono a un obiettivo ambientale e/o sociale

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

***In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?***

Gli Investimenti Sostenibili soddisfano i requisiti DNSH secondo quanto definito dalla legislazione e dal regolamento applicabile.

Il Responsabile degli Investimenti ha sviluppato un insieme di criteri per tutti gli Investimenti Sostenibili per valutare se un emittente o investimento arrechino un danno significativo. Gli investimenti che si considera arrechino un danno significativo non sono qualificati come Investimenti Sostenibili.

Gli investimenti sottostanti la restante porzione di questo prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per le attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

***In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?***

Sono stati presi in considerazione tutti gli indicatori obbligatori dei Principali effetti negativi per assicurare che gli investimenti sostenibili del Comparto non abbiano arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento ambientale o sociale.

Gli indicatori dei Principali effetti negativi ("PAI") sui fattori di sostenibilità per ciascun tipo di investimenti sono stati valutati mediante la metodologia proprietaria per gli Investimenti Sostenibili di BlackRock. BlackRock si avvale dell'analisi fondamentale e/o di fonti terze di dati per identificare investimenti che hanno un impatto negativo sui fattori di sostenibilità e arrecano un danno significativo. Si rimanda alla sezione di seguito "In che modo il presente prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?", che descrive in che modo il Comparto ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità.

— — — *Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:*

Gli investimenti sostenibili del Comparto erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani.

Gli Investimenti Sostenibili sono stati valutati per analizzare eventuali impatti dannosi e garantire la conformità con gli standard internazionali delle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e dei Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani, compresi i principi e i diritti definiti nelle otto convenzioni fondamentali identificate nella Dichiarazione dell'Organizzazione Internazionale del Lavoro in materia di Principi e diritti fondamentali sul lavoro della Carta Internazionale dei Diritti Umani. Emittenti che si ritiene abbiano violato tali convenzioni non sono considerati Investimenti Sostenibili.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



## **In che modo questo prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

La tabella seguente fornisce informazioni sull'impatto dei Principali effetti negativi sugli indicatori di sostenibilità presi in considerazione dal presente Comparto. Il Comparto ha considerato i Principali effetti negativi sugli indicatori di sostenibilità mediante l'applicazione di questi criteri minimi ESG e di esclusione. Il Responsabile degli Investimenti ha stabilito che i PAI contrassegnati nella tabella di seguito come "F" siano pienamente considerati o quelli indicati come "P" considerati parzialmente nel quadro dei criteri di selezione degli investimenti. Un PAI è considerato parzialmente laddove la valutazione interna di BlackRock abbia stabilito che l'indicatore di sostenibilità rispetti in parte la definizione normativa del PAI illustrata nell'Allegato 1 che integra il Regolamento (UE) 2019/2088 dei Regulatory Technical Standards ("RTS"). Un PAI è pienamente considerato laddove la valutazione interna di BlackRock abbia stabilito che l'indicatore di sostenibilità coglie la completa definizione normativa illustrata nell'Allegato 1 che integra il Regolamento (UE) 2019/2088 RTS.

Al di là dell'applicazione dei criteri vincolanti come specificato sopra il Responsabile degli Investimenti non si impegna ulteriormente. Non ci sono azioni intraprese, né programmate, né target fissati per il prossimo periodo di riferimento per i restanti PAI che il Comparto non considera come spiegato in precedenza.

	Indicatore di Sostenibilità				
Indicatore negativo di Sostenibilità	Aziende che producono, effettuano manutenzione o commerciano armi controverse e/o eticamente non accettabili, identificate come tali attraverso impegni, trattati e legislazioni internazionali.	Esclusione di emittenti che si ritiene non abbiano rispettato i principi del Global Compact delle Nazioni Unite.	Esclusione di emittenti che si ritiene siano associati ad esternalità negative.	Esclusione di aziende coinvolte nella produzione di carbone termico e/o nella produzione di energia ricavata da carbone termico che derivano da tali attività oltre il 10% dei loro ricavi consolidati e di aziende coinvolte nella produzione di combustibili controversi e aziende che operano nell'estrazione di idrocarburi con tecniche controverse o in aree ad elevato impatto ambientale. Esclusione di emittenti che si ritiene siano associati ad esternalità negative, incluso il fatto di trarre oltre il 5% dei loro ricavi dalla produzione e generazione di sabbie bituminose (note anche come oil sands o tar sands).	Il Comparto mira a raggiungere una riduzione del punteggio sull'intensità delle emissioni carboniche rispetto all'Indice.
Intensità dei gas serra delle società partecipate					P
Quota di investimenti in società operanti nel settore dei combustibili				P	

<p>Quota di investimenti in società partecipate con siti/operazioni ubicati in o nei pressi di aree sensibili alla biodiversità dove le attività di tali società partecipate ha effetti negativi su dette aree.</p>			P		
<p>Quota di investimenti in società partecipate che sono state coinvolte negativamente in violazioni dei principi dell'UNGC o delle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali</p>		P			
<p>Quota di investimenti in società partecipate coinvolte nella produzione e nella vendita di armi controverse</p>	F				



## Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la **quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: dall'1.07.2022 al 30.06.2023

Maggiori investimenti	Settore	% Attività	Paese
MICROSOFT CORP	Internet, Software e Servizi IT	4,85	USA
ELI LILLY & CO	Prodotti farmaceutici, cosmetici e medicali	2,85	USA
ALPHABET INC -C-	Internet, Software e Servizi IT	2,68	USA
SAP AG	Internet, Software e Servizi IT	2,57	Germania
APPLE INC	Forniture per ufficio e informatica	2,51	USA
MARSH MCLENNAN COS	Assicurazioni	2,21	USA
ASML HOLDING NV	Elettronica e semiconduttori	2,12	Paesi Bassi
MASTERCARD INC -A-	Società finanziaria, di investimento e altre attività diversificate.	2,08	USA
NVIDIA CORP	Elettronica e semiconduttori	2,07	USA
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	Alimentari e bevande	2,01	Svizzera
ASTRAZENECA PLC	Prodotti farmaceutici, cosmetici e medicali	2,00	Gran Bretagna
HERMES INTERNATIONAL SA	Tessile, abbigliamento e pelletteria	1,95	Francia
ING GROUP NV	Banche e altre istituzioni finanziarie	1,71	Paesi Bassi
FANUC CORP SHS	Apparecchi e componenti elettrici	1,70	Giappone
ABBOTT LABORATORIES	Prodotti farmaceutici, cosmetici e medicali	1,69	USA

## Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?

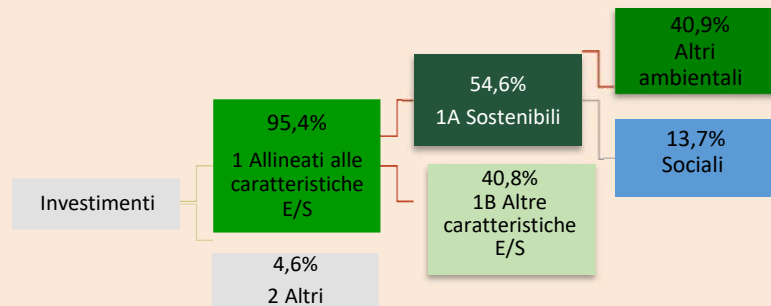
Il Comparto ha investito il 54,6% delle attività in investimenti sostenibili. Di questi, lo 0% era allineato alla Tassonomia UE. Il 40,9% degli investimenti sostenibili sono considerati altri investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e il 13,7% investimenti socialmente sostenibili. Il 40,8% degli investimenti del Comparto sono utilizzati per raggiungere la caratteristica promossa del Comparto durante il periodo di riferimento e non si qualificano come investimenti sostenibili.

Il 4,6% degli investimenti, ovvero la quota restante, non sono né investimenti sostenibili, né investimenti utilizzati per raggiungere le caratteristiche promosse dal Comparto.



### Qual è stata l'asset allocation?

**L'Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.



**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali e sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

La categoria **1 In linea con le caratteristiche E/S** comprende:

- La sottocategoria **1A Sostenibili** comprende investimenti sostenibili socialmente e dal punto di vista ambientale.
- La sottocategoria **1B Altre caratteristiche E/S** comprende investimenti in linea con le caratteristiche ambientali o sociali che non si qualificano come investimenti sostenibili.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?**

<b>Settore</b>	<b>% delle attività nette</b>
Prodotti farmaceutici e cosmetici	12,89
Internet e servizi Internet	12,34
Elettronica e semiconduttori	12,24
Banche e altre istituzioni finanziarie	6,41
Cibi e bevande non alcoliche	6,14
Ingegneria elettrica ed elettronica	5,30
Veicoli stradali	4,51
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	3,90
Assicurazione	3,73
Servizi sanitari e sociali	3,41
Forniture per ufficio e informatica	2,51
Petrolio	2,33
Prodotti chimici	2,25
Holding e società finanziarie	2,20
Trasporto	2,07
Servizi di pubblica utilità	2,07
Tessile e abbigliamento	1,95
Alberghi e ristoranti	1,81
Arti grafiche ed editoria	1,63
Costruzione di macchine e apparecchi	1,56
Materiali per l'edilizia e commercio	1,48
Società immobiliari	1,48
Comunicazioni	1,46
Servizi vari	0,67
Fondi di investimento	0,22
Metalli e pietre preziose	0,21
<b>Totale</b>	<b>96,77</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>3,23</b>



Per rispettare la Tassonomia UE, i criteri per il gas fossile includono limitazioni alle emissioni e il passaggio a energia completamente rinnovabile o a combustibili a basso contenuto di carbonio entro la fine del 2035. Per l'energia nucleare, i criteri comprendono regole complete per sicurezza e gestione dei rifiuti.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di produrre un contributo sostanziale verso un obiettivo ambientale.

Le **attività transitorie** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basso contenuto di carbonio e che, tra le altre, presentano livelli di emissioni di gas serra pari alle migliori prestazioni.



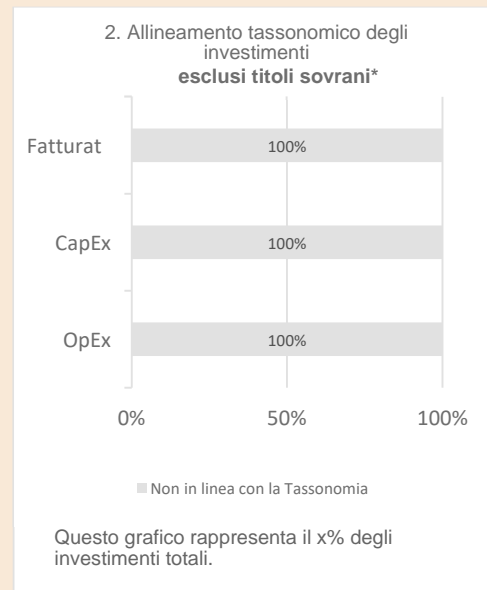
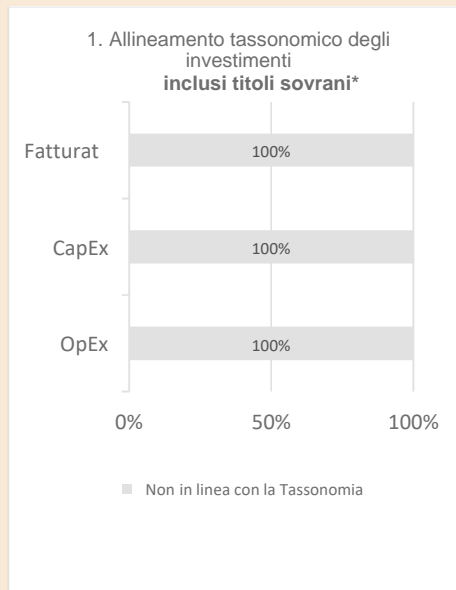
## In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?

La quota degli investimenti del Comparto allineata con la Tassonomia UE è pari a 0%.

### Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE<sup>1</sup>?

Sì:
   
 In gas fossile     In energia nucleare
   
 No

*I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.*



\* Per le finalità di questi grafici, 'titoli sovrani' comprende tutte le esposizioni sovrane.

<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, che riflette la quota di ricavi di attività green delle società partecipate.
- **spese in conto capitale (CapEx)** che mostrano gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad esempio per la transizione verso un'economia green.
- **spese operative (OpEx)**, che riflettono le attività operative green delle società partecipate.



sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale secondo il Regolamento (UE) 2020/852.

● **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Per il periodo di riferimento lo 0% degli investimenti del Comparto sono identificati, per le finalità della presente Relazione, come attività transitorie e abilitanti.

● **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

La quota degli investimenti del Fondo allineati con la Tassonomia UE è pari a 0%.

Si tratta del primo periodo di riferimento in cui il Comparto ha comunicato la quota degli investimenti in linea con la Tassonomia UE.



● **Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Al termine del periodo di riferimento la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non in linea con la Tassonomia UE era pari al 40,9%.



● **Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

Al termine del periodo di riferimento la quota di investimenti socialmente sostenibili era pari al 13,7%



● **Quali investimenti erano inclusi in "Altri", qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**

Gli investimenti inclusi in "2 Altri" comprendono derivati e liquidità, in misura comunque mai superiore al 30%. Tali investimenti sono stati utilizzati solo a fini di investimento nel perseguimento dell'obiettivo di investimento (non ESG) del Comparto, per finalità di gestione della liquidità e/o di copertura.

Nessun altro investimento detenuto dal Comparto è stato valutato rispetto alle tutele minime ambientali o sociali.



## Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?

Il Responsabile degli Investimenti ha implementato controlli interni di qualità, quali la codifica di regole di compliance per garantire la conformità alle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto. Il Responsabile degli Investimenti esamina periodicamente le caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto per garantire che siano ancora adeguate rispetto all'universo di investimento del Comparto. Laddove gli emittenti siano identificati come potenzialmente aventi problemi di buona governance, gli emittenti sono sottoposti a verifiche per garantire che, ove il Responsabile degli Investimenti accetti tale valutazione esterna, sia soddisfatto delle azioni correttive intraprese dall'emittente o che l'emittente intraprenderà in un ragionevole arco di tempo sulla base della collaborazione diretta del Responsabile degli Investimenti con l'emittente. Il Responsabile degli Investimenti può anche decidere di ridurre l'esposizione verso tali emittenti.



## Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?

Per il periodo di riferimento non è stato stabilito un indice come benchmark di riferimento per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto, pertanto questa sezione non è applicabile.

Si fa presente che l'indice MSCI All Country World Index è usato per confrontare alcune caratteristiche ESG promosse dal Comparto.

- ***In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?***

Non applicabile.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?***

Non applicabile.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?***

Non applicabile.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Non applicabile.

**I benchmark di riferimento** sono indici per misurare se il prodotto finanziario raggiunge le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

**Nome del prodotto:**  
onemarkets Pimco Global  
Balanced Allocation Fund

**Identificativo della persona giuridica (LEI):**  
29900IOCRFOWJOB2E74

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

### Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?

**Sì**

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale:** \_\_\_\_\_%

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia UE

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale:** \_\_\_\_\_%

**No**

Ha **promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)** e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del \_\_\_\_\_% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo sociale

Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**



### In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto ha promosso caratteristiche ambientali e sociali attraverso l'applicazione di alcune esclusioni. A questo proposito, nell'arco del periodo considerato PIMCO ha escluso tutte le aziende che generano una specifica quota di ricavi derivata da settori predefiniti al fine di soddisfare il quadro sostenibile il

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

quadro sostenibile del Comparto. Per maggiori dettagli sulle esclusioni e sui loro effetti si rimanda alla sezione “Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?”.

Il Responsabile degli investimenti del Comparto integra le esclusioni in atto sfruttando la propria piattaforma al fine di interagire con gli emittenti in cui investe. Essendo tra i maggiori detentori di obbligazioni al mondo, PIMCO ha un'ampia e importante piattaforma per interagire con gli emittenti al fine di guidare un cambiamento significativo riguardo alle dimensioni della sostenibilità.

● ***Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?***

Nell'arco del periodo considerato, il Comparto ha misurato la performance rispetto a un indicatore sostenibile ovvero l'insieme delle esclusioni dettagliate di seguito.

1. Aziende coinvolte in gravi violazioni del Global Compact delle Nazioni Unite
2. Aziende che producono, effettuano manutenzione o commerciano armi controverse e/o moralmente non accettabili, identificate come tali attraverso impegni, trattati e legislazioni internazionali.
3. Aziende coinvolte nella produzione di carbone termico e/o nella produzione di energia da carbone termico, che derivano da tali attività oltre il 10% dei loro ricavi consolidati. Si richiede inoltre l'uscita obbligatoria entro il 2028.
4. Aziende coinvolte nella produzione di combustibili controversi e aziende che estraggono idrocarburi con tecniche discutibili o in aree ad elevato impatto ambientale.
5. Aziende coinvolte nella produzione del tabacco che derivano da tali attività oltre il 5% dei loro ricavi consolidati.
6. Aziende coinvolte nella produzione di energia nucleare che derivano da tali attività oltre il 15% dei loro ricavi consolidati.
7. Aziende coinvolte nella produzione di armi che derivano da tali attività oltre il 10% dei loro ricavi consolidati.
8. Aziende coinvolte nel business del gioco d'azzardo che derivano da tali attività oltre il 15% dei loro ricavi consolidati.
9. Aziende coinvolte nel business dell'intrattenimento degli adulti che derivano da tali attività oltre il 15% dei loro ricavi consolidati.

Il Comparto ha soddisfatto i requisiti dell'indicatore di sostenibilità di cui sopra durante il presente periodo di rendicontazione. In quanto tutti gli investimenti del Comparto hanno aderito alle esclusioni definite.

● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

L'esercizio finanziario 2022 è il primo per cui la Relazione periodica del Fondo viene fornita in linea con i modelli di reportistica introdotti dal Regolamento Delegato della Commissione (UE) 2022/1288 (SFDR-RTS). Il primo confronto sarà effettuato nella relazione periodica per l'esercizio 2023.

● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Non applicabile. Il Comparto non ha effettuato investimenti sostenibili.

● **In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?**

Non applicabile. Il Comparto non ha effettuato investimenti sostenibili.

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario, che tengono conto dei criteri UE per le attività sostenibili dal punto di vista ambientale.

Gli investimenti sottostanti la restante porzione di questo prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per le attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

— — — *In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Non applicabile. Il Comparto non ha effettuato investimenti sostenibili.

— — — *Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:*

Non applicabile. Il Comparto non ha effettuato investimenti sostenibili.

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



### In che modo questo prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Il Comparto non ha considerato i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità



### Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?

Maggiori investimenti	Settore	% Attività	Paese
BUNDESSCHATZANWEISUN 2.85 23-25 12/06A	Paesi e governi centrali	4,89	Germania
UNITED STATES TR NT 4.625 23-25 30/06S	Paesi e governi centrali	4,58	USA
UNITED STATES TREASU 3.625 23-28 31/05S	Paesi e governi centrali	4,53	USA
UNITED KINGDOM 0.125 12-24 22/03S	Paesi e governi centrali	4,26	UK
UNITED STATES TR NO 4.0 23-28 30/06S	Paesi e governi centrali	4,05	USA
UNITED STATES TREASU 4.25 23-25 31/05S	Paesi e governi centrali	3,35	USA
FRANCE 0.1 14-25 01/03A	Paesi e governi centrali	3,31	Francia
UNITED STATES TREASU 3.375 23-33 15/05S	Paesi e governi centrali	3,14	USA
UNITED STATES 1.625 22- 27 15/10S	Paesi e governi centrali	2,98	USA
UNITED STATES TREASU 3.625 23-53 15/05S	Paesi e governi centrali	2,72	USA

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la **quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: dall'1.07.2022 al 30.06.2023

Per rispettare la Tassonomia UE, i criteri per il gas fossile includono limitazioni alle emissioni e il passaggio a energia completamente rinnovabile o a combustibili a basso contenuto di carbonio entro la fine del 2035. Per l'energia nucleare, i criteri

comprendono regole complete per sicurezza e gestione dei rifiuti.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di produrre un contributo sostanziale verso un obiettivo ambientale.

Le **attività transitorie** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basso contenuto di carbonio e che, tra le altre, presentano livelli di emissioni di gas serra pari alle migliori prestazioni.

**L'Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.

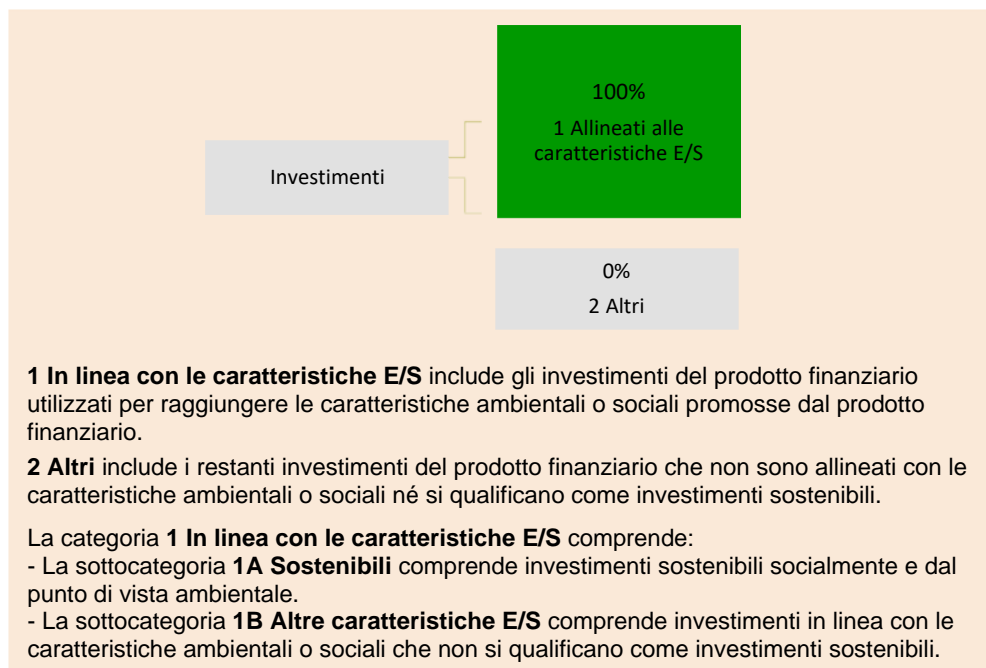
US TREASURY INDEXED 1.25 23-28 15/04S	Paesi e governi centrali	2,43	USA
BUNDSOBLIGATION 2.4 23-28 19/10A	Paesi e governi centrali	2,32	Germania
JAPAN (5 YEAR I 0.2000 23-28 20/03S	Paesi e governi centrali	2,23	Giappone
UNITED STATES 3.5 23-33 15/02S	Paesi e governi centrali	1,74	USA
UNITED KINGDOM 3.25 23-33 31/01S	Paesi e governi centrali	1,7	UK



### Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?

Il Responsabile degli Investimenti ha implementato alcune politiche di esclusione per il presente Comparto, oltre ad interagire con gli emittenti a livello aziendale, per in assenza di linee guida specifiche per il Comparto stesso. Queste esclusioni sono state applicate all'intero account; pertanto il 100% delle partecipazioni dell'account ha aderito a tale quadro di esclusione e sono pertanto tutte in linea con le caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto.

### Qual è stata l'asset allocation?





● ***In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?***

<b>Settori</b>	<b>% delle attività</b>
Obbligazioni di Stati, province e comuni	62,05
Internet e servizi Internet	3,85
Prodotti farmaceutici e cosmetici	3,15
Elettronica e semiconduttori	2,80
Banche e altre istituzioni finanziarie	2,39
Forniture per ufficio e informatica	2,27
Holding e società finanziarie	2,05
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	1,83
Assicurazione	1,69
Fondi di investimento	1,41
Organizzazioni sovranazionali	1,41
Trasporto	1,39
Costruzione di macchine e apparecchi	1,17
Cibi e bevande non alcoliche	1,17
Veicoli stradali	1,13
Petrolio	1,07
Servizi di pubblica utilità	0,98
Comunicazioni	0,79
Società immobiliari	0,71
Prodotti chimici	0,70
Servizi sanitari e sociali	0,70
Alberghi e ristoranti	0,69
Servizi vari	0,63
Miniere di carbone e industria siderurgica	0,49

Materiali per l'edilizia e commercio	0,49
Carta e prodotti forestali	0,48
Metalli non ferrosi	0,41
Beni di consumo vari	0,38
Metalli e pietre preziose	0,29
Ingegneria elettrica ed elettronica	0,20
Tabacco e bevande alcoliche	0,18
Imballaggi	0,16
Arti grafiche ed editoria	0,15
Biotecnologie	0,12
Servizi ambientali e riciclo	0,11
Industria aeronautica e aerospaziale	0,08
Agricoltura e pesca	0,07
Tessile e abbigliamento	0,06
<b>Totale</b>	<b>99,70</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>0,30</b>



### In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?

La quota degli investimenti del Comparto allineata con la Tassonomia UE è pari a 0%.

- **Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE<sup>1</sup>?**

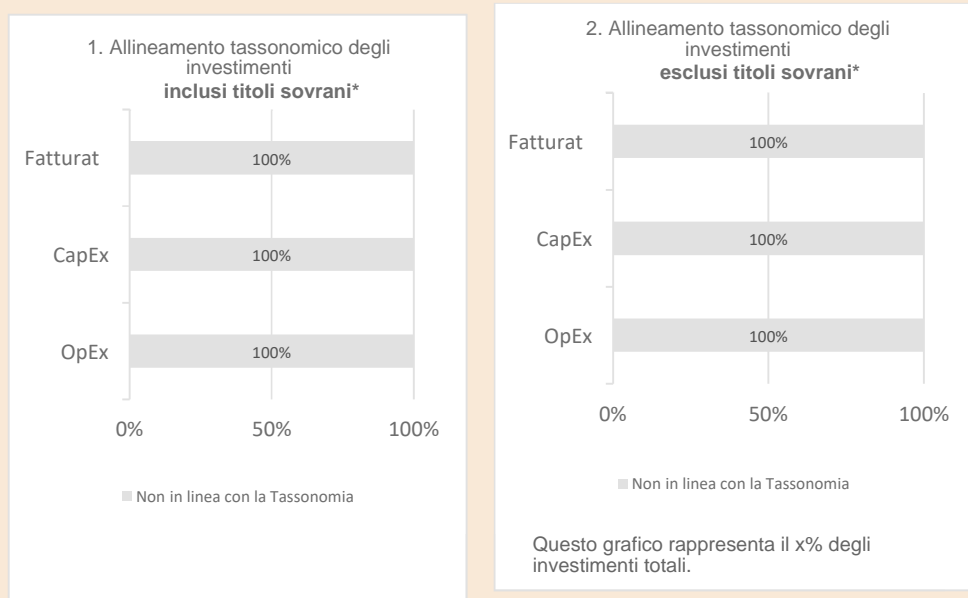
<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

- Sì:
- In gas fossile  In energia nucleare
- No

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, che riflette la quota di ricavi di attività green delle società partecipate.
- **spese in conto capitale (CapEx)** che mostrano gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad esempio per la transizione verso un'economia green.
- **spese operative (OpEx)**, che riflettono le attività operative green delle società partecipate.

**I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.**



\* Per le finalità di questi grafici, 'titoli sovrani' comprende tutte le esposizioni sovrane.

● **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Non applicabile.


● **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

Si tratta del primo periodo di riferimento in cui il Comparto ha comunicato la quota degli investimenti in linea con la Tassonomia UE.



**Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile. Il Comparto non ha effettuato investimenti sostenibili.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale secondo il Regolamento (UE) 2020/852.



### Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?

Non applicabile. Il Comparto non ha effettuato investimenti sostenibili.



### Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?

In conformità con le Linee guida di investimento del Comparto, gli "Altri" investimenti includono strumenti che possono essere stati utilizzati a fini di hedging, investimenti non selezionati a fini di diversificazione, come consentito dalle Linee guida di investimento per il vostro conto e previa applicazione di eventuali elenchi o politiche di esclusione, liquidità residua detenuta a titolo di liquidità accessoria.



### Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?

PIMCO ha intrapreso numerose attività per promuovere le caratteristiche ambientali e sociali del Comparto durante il periodo di riferimento, quali l'applicazione dei criteri di selezione vincolanti specificati nella vostra relazione precontrattuale, che includono quanto segue:

- Applicazione dell'elenco o politica di esclusione, come ulteriormente specificato nelle Linee guida di investimento relativamente al vostro account.

Per quanto riguarda la politica di engagement, per il Comparto non è stata stabilita alcuna linea guida relativa all'engagement degli emittenti come criterio vincolante, né è stato preso alcun impegno preso di collaborazione con un particolare emittente. Malgrado ciò, PIMCO interagisce con gli emittenti a livello aziendale, ciò comprende, su base annuale, oltre 5.000 incontri e call svolti dal nostro team di oltre 80 analisti del credito con gruppi dirigenti di aziende. Oltre a discutere argomenti finanziari, ci concentriamo anche su aspetti strategici relativi ai rischi ESG e alle prassi per una gestione aziendale sostenibile. Il Comparto può pertanto trarre beneficio dal programma di engagement a livello aziendale di PIMCO, considerato che alcuni emittenti possono essere detenuti nell'ambito di molteplici strategie.

I **benchmark di riferimento** sono indici per misurare se il prodotto finanziario raggiunge le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.



### Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?

Non applicabile. Il prodotto finanziario non ha indicato un indice come benchmark di riferimento per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Comparto.

- ***In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?***

Non applicabile.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?***

Non applicabile.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?***

Non applicabile.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Non applicabile.

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

**Nome del prodotto:**  
onemarkets J.P. Morgan  
Emerging Countries Fund

**Identificativo della persona giuridica (LEI):**  
529900F3CH3CCB2JBK02

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

### Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?

**Sì**

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale:** \_\_\_\_%

- in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE
- in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia UE

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale:** \_\_\_\_%

**No**

Ha **promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)** e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del 50,48% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia UE

con un obiettivo sociale

Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**



### In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto si propone di promuovere un'ampia gamma di caratteristiche ambientali, sociali e di governance attraverso i suoi criteri di inclusione degli investimenti, nello specifico con un'asset allocation che prevede almeno il 51% di investimenti con caratteristiche ambientali e/o sociali positive e almeno il 10% di investimenti considerati sostenibili. Tale impegno è stato rispettato per tutto il

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

periodo di riferimento (1 luglio 2022 - 30 giugno 2023). Al termine del periodo di riferimento, il Comparto deteneva il 78,16% degli investimenti complessivi con caratteristiche ambientali e/o sociali positive e il 50,48% di investimenti sostenibili.

Il Comparto ha rispettato gli impegni minimi precontrattuali riguardo alle caratteristiche ambientali e/o sociali e alla politica di investimenti sostenibili per tutto il periodo di riferimento. Il Comparto ha applicato filtri allo scopo di escludere tutti i potenziali investimenti vietati ai sensi della propria politica di esclusione per tutto il periodo. La misura in cui le norme e i valori promossi dal Comparto sono stati soddisfatti si basa sul fatto che il Comparto abbia detenuto durante il periodo di riferimento aziende che sarebbero state vietate secondo la politica di esclusione. Il Responsabile degli Investimenti non ha indicazioni che siano state detenute tali aziende. Il Responsabile degli Investimenti informa che la continuità dei valori percentuali e delle informazioni comunicate non può essere garantite in futuro ed è soggetta alla continua evoluzione del panorama giuridico e regolamentare. La durata del periodo di riferimento può essere inferiore a 12 mesi se il Fondo viene lanciato, chiuso o ha modificato il proprio stato di Articolo 8/9 durante tale periodo.

#### ● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Una combinazione della metodologia di scoring ESG proprietaria del Responsabile degli Investimenti, consistente del punteggio ESG proprietario del Responsabile degli Investimenti e/o dati di terzi, è stata utilizzata nel quadro dei criteri di inclusione per misurare il raggiungimento delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Comparto.

La metodologia si è basata sulla gestione delle questioni ambientali o sociali rilevanti di un'azienda quali sue emissioni tossiche, gestione dei rifiuti, relazioni sindacali e sicurezza, diversità/indipendenza del Consiglio di Amministrazione e riservatezza dei dati. Per essere inclusa nel 51% degli asset che si considerano promuovere caratteristiche ambientali e/o sociali, un'azienda deve rientrare nell'80% dei punteggi migliori rispetto ai propri peer o a livello ambientale o sociale e rispettare le prassi di buona governance illustrate in precedenza.

Al termine del periodo di riferimento, il Comparto deteneva il 78,16% di investimenti con caratteristiche ambientali e/o sociali positive e il 50,48% di investimenti sostenibili.

Riguardo alle esclusioni applicate basate su norme e valori, il Responsabile degli Investimenti ha impiegato dati per misurare la partecipazione di

un'azienda alle attività rilevanti. La selezione basata su tali dati ha portato alla totale esclusione di alcuni potenziali investimenti e all'esclusione parziale con una soglia percentuale massima di ricavi o produzione come previsto dalla nostra politica di esclusione. Durante il periodo di riferimento le regole di esclusione non sono mai state violate. Nel processo di selezione è stato incorporato anche un sottoinsieme degli indicatori negativi di sostenibilità, come stabilito nei Regulatory Technical Standards (RTS) del Regolamento SFDR UE.

Il Comparto non aveva alcun target specifico di allocation a favore di caratteristiche ambientali o sociali e pertanto qui non viene indicata la performance degli indicatori relativamente a specifiche caratteristiche ambientali o sociali.

● ***... e rispetto ai periodi precedenti?***

Non applicabile per il 2022

● ***Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?***

Gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il Comparto ha parzialmente effettuato consistevano in alcuni obiettivi singoli o combinazione di obiettivi seguenti durante il periodo di riferimento:

Obiettivi ambientali: (i) mitigazione del rischio climatico, (ii) transizione verso un'economia circolare

Obiettivi sociali: (i) comunità inclusive e sostenibili - maggiore rappresentanza femminile a livello executive, (ii) comunità inclusive e sostenibili - maggiore rappresentanza femminile nei Consigli di Amministrazione e (iii) garantire un ambiente di lavoro e una cultura dignitosi.

Il contributo a tali obiettivi è stato determinato da (i) indicatori di sostenibilità relativi a prodotti e servizi che possono aver incluso la percentuale di ricavi derivati dalla fornitura di prodotti e servizi che hanno contribuito all'obiettivo sostenibile rilevante, ad esempio un'azienda che produce pannelli solario tecnologia per energia pulita che ha soddisfatto le soglie proprietarie del Responsabile degli Investimenti contribuendo alla mitigazione del rischio climatico. La percentuale attuale dei ricavi è fissata ad almeno il 20% e l'intera partecipazione nella società è considerata un investimento sostenibile; oppure (ii) essere un leader operativo nel gruppo di peer che contribuisce all'obiettivo rilevante. Per essere un leader del gruppo di peer si intende avere uno scoring che si colloca nel 20% superiore rispetto ai peer relativamente ad alcuni indicatori operativi di sostenibilità. Ad esempio, avere un punteggio nel 20% superiore rispetto ai peer riguardo all'impatto totale dei rifiuti contribuisce alla transizione verso un'economia circolare.



Il contributo effettivo a tali obiettivi può essere compreso considerando la percentuale effettiva di asset allocati a investimenti sostenibili per il periodo di riferimento. Al Comparto è stato richiesto di investire il 10% in investimenti sostenibili. In nessun momento durante il periodo di riferimento il Comparto ha detenuto investimenti sostenibili inferiori a tale impegno minimo. Al termine del periodo di riferimento, il 50,48% dei suoi asset erano costituiti da investimenti sostenibili.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

***In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?***

Gli investimenti sostenibili che il Comparto intendeva effettuare sono stati sottoposti a un processo di selezione, che ha cercato di identificare ed escludere dalla classificazione come investimenti sostenibili quelle aziende che il Responsabile degli Investimenti considerava come quelle con le prestazioni peggiori rispetto alla soglia stabilita dal Responsabile degli Investimenti in relazione ad alcune considerazioni ambientali. Conseguentemente, solo le aziende che hanno mostrato i migliori indicatori rispetto a misure sia assolute che relative sono state considerate come investimenti sostenibili.

Tali considerazioni includono il cambiamento climatico, la protezione delle risorse idriche e marine, la transizione verso un'economia circolare, l'inquinamento e la tutela della biodiversità e degli ecosistemi. Il Responsabile degli Investimenti ha, inoltre, applicato anche un filtro che cercava di identificare ed escludere quelle aziende che il Responsabile degli Investimenti considera in violazione delle Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali e dei Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani, sulla base di dati provenienti da fornitori esterni.

— — — *In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Tutti gli indicatori obbligatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità contenuti nella Tabella 1 dell'Allegato 1 e alcuni indicatori stabiliti dal Responsabile degli Investimenti nelle Tabelle 2 e 3 dell'Allegato 1 dei Regulatory Technical Standards (RTS) del Regolamento UE SFDR sono stati presi in considerazione, come descritto più in dettaglio di seguito. Il Responsabile degli Investimenti ha utilizzato i parametri dei Regulatory Technical Standards del Regolamento SFDR UE oppure, ove ciò non fosse possibile a causa di limitazioni dei dati o altri problemi tecnici, un sostituto analogo. Il Responsabile degli Investimenti ha consolidato la valutazione di alcuni indicatori in un indicatore "primario", come illustrato di seguito, e può aver impiegato un insieme aggiuntivo di indicatori più ampio rispetto al riferimento di seguito.

Gli indicatori rilevanti nella Tabella 1 dell'Allegato 1 dei Regulatory Technical Standards (RTS) del Regolamento UE SFDR consistono di 9 indicatori ambientali e

5 indicatori sociali e relativi ai dipendenti. Gli indicatori ambientali sono numerati da 1 a 9 e si riferiscono a emissioni di gas serra (1-3), esposizione a combustibile fossile, percentuale di consumo e produzione di energia non rinnovabile, intensità del consumo energetico, attività che influenzano negativamente aree sensibili alla biodiversità, emissioni in acqua e rifiuti pericolosi (4-9 rispettivamente). Gli indicatori da 10 a 14 si riferiscono ad aspetti aziendali sociali e relativi ai dipendenti e riguardano violazioni dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite e le Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali, l'assenza di processi e meccanismi di conformità per monitorare la compliance con i principi del Global Compact delle Nazioni Unite, divario salariale di genere non rettificato, diversità di genere del Consiglio di Amministrazione, esposizione ad armi controverse (mine antiuomo, munizioni a grappolo, armi chimiche e biologiche) rispettivamente.

L'approccio del Responsabile degli Investimenti comprendeva sia aspetti quantitativi che aspetti qualitativi per tenere conto degli indicatori di cui sopra. Sono stati utilizzati indicatori particolari per lo screening, cercando di escludere le aziende che possono causare un danno significativo. Inoltre, è stato utilizzato un sottoinsieme per l'engagement con alcune aziende, cercando di incoraggiare migliori prassi e alcune di queste sono state utilizzate come indicatori di performance di sostenibilità positive, con l'applicazione di una soglia minima rispetto all'indicatore per la classificazione come investimento sostenibile. I dati necessari per tenere conto degli indicatori, laddove disponibili, possono essere stati ottenuti dalle società partecipate stesse e/o forniti da fornitori terzi di servizi (inclusi dati sostitutivi). I dati forniti dalle società stesse o da fornitori terzi possono essere basati su serie di dati e ipotesi che possono essere insufficienti, di scarsa qualità o contenere informazioni distorte. A causa

della dipendenza da terzi, il Responsabile degli Investimenti non può garantire l'accuratezza o la completezza di tali dati.

### Screening

Alcuni degli indicatori sono stati presi in considerazione attraverso la selezione basata su norme e valori per implementare le esclusioni. Queste esclusioni hanno tenuto conto degli indicatori 10 e 14 in relazione ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite e alle Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali e le armi controverse. Il Responsabile degli Investimenti ha inoltre applicato un filtro appositamente predisposto. A causa di alcune considerazioni tecniche, quali la copertura dei dati per indicatori specifici, il Responsabile degli Investimenti ha applicato l'indicatore specifico come da Tabella 1 oppure un sostituto rappresentativo, come stabilito dal Responsabile degli Investimenti, per selezionare le aziende partecipate riguardo agli aspetti rilevanti ambientali, sociali e relativi ai dipendenti. Ad esempio, le emissioni di gas serra sono associate a diversi indicatori e ai parametri corrispondenti della Tabella 1, come emissioni di gas serra, impronta carbonica e intensità dei gas serra (indicatori 1-3). Il Responsabile degli Investimenti ha utilizzato dati relativi all'intensità dei gas serra (indicatore 3), dati relativi a consumo e produzione di energia non rinnovabile (indicatore 5) e dati sull'intensità dei consumi energetici (indicatore 6) per eseguire la sua selezione relativamente alle emissioni di gas serra.

Relativamente al filtro appositamente predisposto e riguardo alle attività che influenzano negativamente le aree sensibili alla biodiversità e le emissioni in acqua (indicatori 7 e 8), a causa di limitazioni dei dati sono stati impiegati dati sostitutivi rappresentativi di parti terze anziché gli indicatori specifici secondo la Tabella 1. Il Responsabile degli Investimenti ha inoltre tenuto conto dell'indicatore 9 relativo ai rifiuti pericolosi rispetto al filtro appositamente predisposto.

### Engagement

Oltre ad escludere alcune aziende, come descritto in precedenza, il Responsabile degli Investimenti ha collaborato su base continuativa con selezionate aziende partecipate sottostanti. È stato utilizzato un sottoinsieme di indicatori, soggetti ad alcune valutazioni tecniche, quali la copertura a livello di dati, come base per collaborare con aziende partecipate sottostanti in linea con l'approccio adottato dal Responsabile degli Investimenti riguardo a stewardship ed engagement. Gli indicatori utilizzati per l'engagement comprendono gli indicatori 3, 5 e 13 relativi a intensità delle emissioni di gas serra, quota di energia non rinnovabile e diversità di genere dei Consigli di Amministrazione dalla Tabella 1. Sono stati usati anche gli indicatori 2 nella Tabella 2 e 3 nella Tabella 3 relativamente a emissioni o inquinanti atmosferici e numero di giorni persi per infortuni, incidenti, decessi o malattie.

## Indicatori di sostenibilità

Il Responsabile degli Investimenti ha utilizzato gli indicatori 3 e 13 relativi a intensità dei gas serra e diversità di genere dei Consigli di Amministrazione come indicatori di sostenibilità, a supporto della classificazione di un investimento come sostenibile. Uno dei percorsi richiedeva che un'azienda fosse considerata un leader operativo del gruppo di peer per qualificarsi come investimento sostenibile. Ciò richiedeva un punteggio relativo all'indicatore nel 20% superiore rispetto ai peer.

Per principali effetti negativi si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussioni.

— — — *Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:*

Gli investimenti sostenibili del Comparto erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani.

A fini di allineamento a queste linee guida e principi sono state applicate esclusioni dal portafoglio basate su norme, secondo quanto descritto in risposta a "In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?". Per identificare potenziali violazioni sono stati utilizzati dati di terze parti. A meno della concessione di una deroga, il Comparto ha vietato investimenti rilevanti in tali emittenti.



## **In che modo il presente prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

Il Comparto ha considerato Principali effetti negativi selezionati sui fattori di sostenibilità mediante filtri basati su norme e valori per implementare esclusioni. Per tale selezione sono stati utilizzati gli indicatori 10 e 14 relativi a violazioni del Global Compact delle Nazioni Unite e ad armi controverse tratti dai Regulatory Technical Standards del Regolamento SFDR UE.

Il Comparto ha impiegato anche alcuni indicatori nel quadro del filtro "Non arrecare un danno significativo" come dettagliato nella risposta alla domanda immediatamente sopra per dimostrare che un investimento si è qualificato come sostenibile.

Un sottoinsieme dei suddetti Indicatori negativi di sostenibilità è stato impiegato per stabilire l'engagement con aziende partecipate sulla base della performance dei loro rispettivi PAI.



## Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la **quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: dall'1.07.2022 al 30.06.2023

Maggiori investimenti	Settore	% Attività	Paese
TAIWAN SEMICONDUCTOR	Information Technology	5,55	Taiwan
JPMETF IRL GBL EM RES	Fondi di investimento	4,97	Irlanda
HDFC BANK LTD-ADR	Finanziari	4,00	India
SAMSUNG ELECTRONICS	Information Technology	3,60	Corea del Sud
TENCENT HOLDINGS LTD	Comunicazione	3,01	Isole Cayman
ICICI BANK LTD	Finanziari	2,31	India
HAIER SMART HOME CO	Beni di consumo discrezionali	1,79	Cina
INFOSYS LTD	Information Technology	1,42	India
NONGFU SPRING CO LTD-H	Beni di prima necessità	1,34	Cina
NETEASE INC	Comunicazione	1,27	Isole Cayman
WIPRO LTD	Information Technology	1,24	India
ALIBABA GROUP HOLDING	Beni di consumo discrezionali	1,21	Isole Cayman
UNILEVER PLC	Beni di prima necessità	1,18	Regno Unito
SK HYNIX INC	Information Technology	1,15	Corea del Sud
BUDWEISER BREWING CO	Beni di prima necessità	1,09	Isole Cayman



## Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?

Il Comparto ha investito il 50,48% delle attività in investimenti sostenibili. Di questi, lo 0% era allineato alla Tassonomia UE. Il 32,65% degli investimenti sostenibili sono considerati altri investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e il 17,83% investimenti socialmente sostenibili.

Il 27,68% degli investimenti del Comparto sono utilizzati per raggiungere la caratteristica del Comparto durante il periodo di riferimento e non si qualificano come investimenti sostenibili.

Il 21,48% degli investimenti, ovvero la quota restante, non sono né investimenti sostenibili, né investimenti utilizzati per raggiungere le caratteristiche promosse dal Comparto.

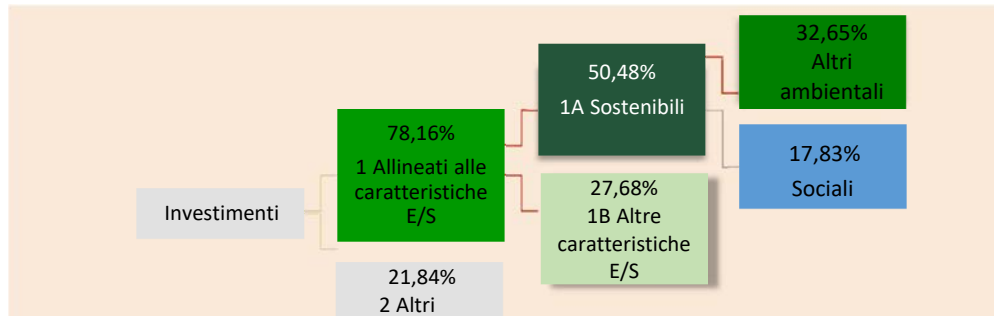
**L'Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.

Per rispettare la Tassonomia UE, i criteri per il gas fossile includono limitazioni alle emissioni e il passaggio a energia completamente rinnovabile o a combustibili a basso contenuto di carbonio entro la fine del 2035. Per l'**energia nucleare**, i criteri comprendono regole complete per sicurezza e gestione dei rifiuti.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di produrre un contributo sostanziale verso un obiettivo ambientale.

Le **attività transitorie** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basso contenuto di carbonio e che, tra le altre, presentano livelli di emissioni di gas serra pari alle migliori prestazioni.

● **Qual è stata l'asset allocation?**



**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

La categoria **1 In linea con le caratteristiche E/S** comprende:

- La sottocategoria **1A Sostenibili** comprende investimenti sostenibili socialmente e dal punto di vista ambientale.
- La sottocategoria **1B Altre caratteristiche E/S** comprende investimenti in linea con le caratteristiche ambientali o sociali che non si qualificano come investimenti sostenibili.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli**

Sebbene il Comparto abbia promosso alcune caratteristiche ambientali e sociali attraverso propri criteri di inclusione e di esclusione, può aver investito in un'ampia gamma di settori -- si rimanda all'elenco di seguito. Inoltre, il Responsabile degli Investimenti ha collaborato su base continuativa con selezionate aziende partecipate sottostanti. Investimenti in settori e sottosettori economici che derivano ricavi da esplorazione, mining, estrazione, produzione, lavorazione, stoccaggio, raffinazione o distribuzione, inclusi trasporti, stoccaggio e commercializzazione, di combustibili fossili saranno inserite nella tabella di seguito, se detenuti. Attività liquide accessorie, depositi presso istituti di credito, strumenti/fondi del mercato monetario, (per la gestione di sottoscrizioni e rimborsi cash oltre che per pagamenti straordinari) e derivati per EPM sono inclusi al denominatore per la percentuale delle attività riportate nella tabella che segue.

Settori / Subsettori	% delle attività nette
Banche e altre istituzioni finanziarie	15,27
Elettronica e semiconduttori	14,00

Internet e servizi Internet	11,55
Holding e società finanziarie	6,40
Cibi e bevande non alcoliche	5,85
Fondi di investimento	5,79
Ingegneria elettrica ed elettronica	5,50
Petrolio	4,07
Commercio al dettaglio e grandi magazzini	3,80
Assicurazione	2,95
Veicoli stradali	2,37
Prodotti farmaceutici e cosmetici	2,06
Forniture per ufficio e informatica	2,06
Comunicazioni	1,92
Prodotti chimici	1,64
Trasporto	1,60
Costruzione di macchine e apparecchi	1,41
Alberghi e ristoranti	1,29
Materiali per l'edilizia e commercio	1,27
Società immobiliari	1,09
Biotecnologie	0,86
Miniere di carbone e industria siderurgica	0,82
Tessile e abbigliamento	0,82
Metalli non ferrosi	0,78
Beni di consumo vari	0,66
Servizi di pubblica utilità	0,53
Arti grafiche ed editoria	0,41
Tabacco e bevande alcoliche	0,36

Servizi sanitari e sociali	0,36
Carta e prodotti forestali	0,31
Servizi vari	0,30
Fotografia e ottica	0,23
Metalli e pietre preziose	0,18
Pneumatici e gomma	0,13
Industria aeronautica e aerospaziale	0,10
Imballaggi	0,09
Agricoltura e pesca	0,06
Istituzioni non classificabili/non classificate	0,04
<b>Totale</b>	<b>98,93</b>
<b>Altre attività/(passività) nette</b>	<b>1,07</b>



### In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?

La quota degli investimenti del Comparto allineata con la Tassonomia UE è pari a 0%.

### ● Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE<sup>1</sup>?

Sì:  
 In gas fossile  In energia nucleare  
 No

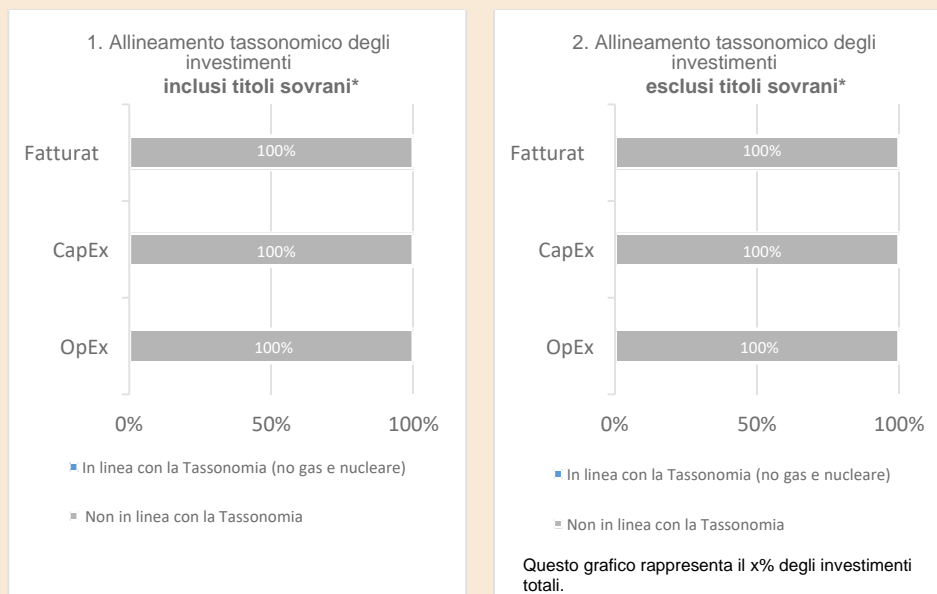
<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.



Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, che riflette la quota di ricavi di attività green delle società partecipate.
- **spese in conto capitale (CapEx)** che mostrano gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad esempio per la transizione verso un'economia green.
- **spese operative (OpEx)**, che riflettono le attività operative green delle società partecipate.

**I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.**



\* Per le finalità di questi grafici, 'titoli sovrani' comprende tutte le esposizioni sovrane.

● **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Oltre a quanto sopra, il Comparto non ha preso alcun impegno minimo ad effettuare investimenti allineati con la Tassonomia UE -- incluse attività transitorie e abilitanti.

● **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

Non applicabile



sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale secondo il Regolamento (UE) 2020/852.



● **Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Al termine del periodo di riferimento la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non in linea con la Tassonomia UE era pari al 32,65% delle attività.



● **Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

La quota di investimenti socialmente sostenibili alla fine del periodo di riferimento era pari al 17,83%.



### **Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**

Il 21,84% degli asset in “Altri” investimenti erano aziende che non rispettavano i criteri descritti in risposta alla domanda precedente “Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?” per qualificarsi come caratteristiche positive ambientali o sociali. Si tratta di investimenti a fini di diversificazione. Attività liquide accessorie, depositi presso istituti di credito, strumenti/fondi del mercato monetario (per la gestione di sottoscrizioni e rimborsi cash, oltre che per pagamenti straordinari) e derivati per EPM non sono stati inclusi nella percentuale delle attività incluse nel diagramma dell'asset allocation riportato sopra, inclusi quelli alla voce "Altri". Queste partecipazioni oscillano in base ai flussi di investimento e sono accessorie rispetto alla politica di investimento con un impatto minimo o nullo sulle operazioni di investimento.

Tutti gli investimenti, inclusi gli "Altri" investimenti, erano soggetti alle seguenti tutele/principi minimi ESG:

Le tutele minime, secondo quanto descritto dall'Articolo 18 del Regolamento tassonomico UE (incluso l'allineamento alle Linee guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti Umani), come attuate dal Responsabile degli Investimenti.

L'applicazione di prassi di buona governance (ad esempio, solide strutture di gestione, relazioni sindacali, retribuzione del personale e compliance fiscale), come attuato dal Responsabile degli Investimenti.

Il rispetto del principio "Non arrecare un danno significativo", secondo quanto stabilito nella definizione di investimento sostenibile nel Regolamento SFDR.



### **Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Durante il periodo di riferimento sono stati applicati i seguenti elementi vincolanti della strategia di investimento per selezionare gli investimenti, al fine di raggiungere ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali:

Gli investimenti sono stati determinati mediante l'applicazione di criteri di inclusione ed esclusione sia a livello di asset che di prodotto. I criteri di inclusione sono supportati da un punteggio ESG assegnato a tutti gli investimenti all'interno della strategia, al fine di identificare quelli che potrebbero essere considerati aventi caratteristiche ambientali e/o sociali e quelli che rispettano le soglie per essere considerati investimenti sostenibili.

Il punteggio ESG tiene conto dei seguenti indicatori: gestione efficace delle emissioni tossiche, rifiuti, buoni dati ambientali e caratteristiche sociali, quali informativa efficace in materia di sostenibilità, punteggi positivi riguardo a relazioni sindacali e gestione delle tematiche attinenti alla sicurezza.

Attraverso i propri criteri di esclusione (con applicazione di esclusioni sia complete che parziali); il Comparto ha promosso alcune norme e valori, quali il sostegno alla tutela di diritti umani proclamati a livello internazionale. Il Comparto ha completamente escluso aziende coinvolte nella produzione di armi controverse e ha applicato soglie massime di ricavi o produzione ad altre, quali quelle coinvolte nel carbone termico e nel tabacco.

Per quanto riguarda la valutazione di buona governance, tutti gli investimenti (esclusi liquidità e derivati) sono stati selezionati al fine di escludere le aziende note per violazione di prassi di buona governance. In aggiunta, per quegli investimenti che si considera abbiano caratteristiche ambientali e/o sociali oppure si qualificano come investimenti sostenibili, sono state applicate considerazioni aggiuntive. Per questi investimenti il Comparto ha incorporato un confronto a livello di gruppo dei peer e ha escluso le aziende che non ottenevano un punteggio nell'80% superiore rispetto ai peer riguardo agli indicatori di buona governance.

Il Comparto non aveva alcun target specifico di allocation a favore di caratteristiche ambientali o sociali. La misura in cui le caratteristiche ambientali e sociali promosse sono state rispettate può essere dedotta considerando la percentuale effettiva di asset allocati per il periodo di riferimento alle aziende rilevanti che mostrano tali caratteristiche.

Ulteriori informazioni sull'engagement sono fornite nella risposta alla domanda "In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?"



## Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?

### I Benchmark di riferimento

sono indici per misurare se il prodotto finanziario raggiunge le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

Non applicabile

- ***In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?***

Non applicabile

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?***

Non applicabile

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?***

Non applicabile

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Non applicabile

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Nome del prodotto:

Identificativo della persona giuridica (LEI):

onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund

529900TFFDAMI5D4HP37

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche sostenibili dal punto di vista sociale. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

### Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?

**Sì**

**No**

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale**: \_\_\_\_\_%

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale**: \_\_\_\_\_%

Ha **promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)** e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del \_\_\_\_\_% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo sociale

Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**



## In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto "onemarkets J.P. Morgan US Equities Fund" (il "Comparto") è stato lanciato il 30 giugno 2023 e non ha effettuato alcun investimento nel periodo di riferimento (1 luglio 2022 – 30 giugno 2023). Pertanto il Responsabile non ha potuto promuovere alcuna delle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto, né raggiungere durante il periodo di riferimento la prevista allocazione degli investimenti indicata nel documento informativo precontrattuale del Comparto.

Le seguenti domande non erano applicabili al termine del periodo di riferimento.

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Non applicabile.

● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

Non applicabile.

● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Non applicabile.

● **In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?**

Non applicabile.

*In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Non applicabile.

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

— — Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:

Non applicabile.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



**In che modo questo prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

Non applicabile.



**Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?**

Non applicabile.

L'elenco include gli investimenti che costituiscono **la quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: dall'1.07.2022 al 30.06.2023



**Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?**

Non applicabile.

● **Qual è stata l'asset allocation?**

L'**Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.

Non applicabile.

Non applicabile.

**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?**

Non applicabile.



**In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.

● **Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE?<sup>1</sup>**



Sì:



In gas fossile



In energia nucleare



No

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, riflette il livello di "greenness" delle società partecipate attualmente.
- **spese in conto capitale** (CapEx), evidenzia gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad es. per la transizione all'economia green.
- **spese operative** (OpEx), che riflettono le attività operative green delle società partecipate.

*I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.*

Non applicabile.

\* Per le finalità di questi grafici, "titoli sovrani" comprende tutte le esposizioni sovrane.

<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.



- **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Non applicabile.

- **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

Non applicabile.



**Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.



**Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

Non applicabile.



**Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**

Non applicabile.



**Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Non applicabile.



**Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile. Il prodotto finanziario non ha indicato un indice come benchmark di riferimento per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Comparto.

- **In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Non applicabile.

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Nome del prodotto:

Identificativo della persona giuridica (LEI):

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

onemarkets Allianz Global Equity Future  
Champions Fund

5299007IOIQMOCCH4Y24

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

### Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?

**Sì**

**No**

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale:** \_\_\_\_\_%

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale:** \_\_\_\_\_%

Ha promosso **caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)** e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del \_\_\_\_\_% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo sociale

Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche sostenibili dal punto di vista sociale. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.



## In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto “onemarkets Allianz Global Equity Future Champions Fund” (il “Comparto”) è stato lanciato il 30 giugno 2023 e non ha effettuato alcun investimento nel periodo di riferimento (1 luglio 2022 – 30 giugno 2023). Pertanto il Responsabile non ha potuto promuovere alcuna delle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto, né raggiungere durante il periodo di riferimento la prevista allocazione degli investimenti indicata nel documento informativo precontrattuale del Comparto.

Le seguenti domande non erano applicabili al termine del periodo di riferimento.

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Non applicabile.

● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

Non applicabile.

● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Non applicabile.

● **In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?**

Non applicabile.

*In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Non applicabile.

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

— — Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:

Non applicabile.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



**In che modo il presente prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

Non applicabile.



**Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?**

Non applicabile.

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la **quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: 01.07.2022 – 30.06.2023



**Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?**

Non applicabile.

● **Qual è stata l'asset allocation?**

L'**Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.

Non applicabile.

Non applicabile.

**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?**

Non applicabile.



**In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.

● **Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE?<sup>1</sup>**



Sì:



In gas fossile



In energia nucleare



No

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, riflette il livello di "greenness" delle società partecipate attualmente.
- **spese in conto capitale** (CapEx), evidenzia gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad es. per la transizione all'economia green.
- **spese operative** (OpEx), che riflettono le attività operative green delle società partecipate.

*I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.*

Non applicabile.

\* Per le finalità di questi grafici, "titoli sovrani" comprende tutte le esposizioni sovrane.

<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

- **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Non applicabile.

- **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

Non applicabile.



**Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.



**Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

Non applicabile.



**Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**

Non applicabile.



**Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Non applicabile.



**Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile. Il prodotto finanziario non ha indicato un indice come benchmark di riferimento per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Comparto.

- **In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile.

- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Non applicabile.



**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Nome del prodotto:

Identificativo della persona giuridica (LEI):

onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund

529900X1AW2N0LT5PT42

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche sostenibili dal punto di vista sociale. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

### Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?

**Sì**

**No**

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale**: \_\_\_\_\_%

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale**: \_\_\_\_\_%

Ha **promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)** e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del \_\_\_\_% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo sociale

Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**



## In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto “onemarkets Allianz Conservative Multi-Asset Fund” (il “Comparto”) è stato lanciato il 30 giugno 2023 e non ha effettuato alcun investimento nel periodo di riferimento (1 luglio 2022 – 30 giugno 2023). Pertanto il Responsabile non ha potuto promuovere alcuna delle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto, né raggiungere durante il periodo di riferimento la prevista allocazione degli investimenti indicata nel documento informativo precontrattuale del Comparto.

Le seguenti domande non erano applicabili al termine del periodo di riferimento.

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Non applicabile.

● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

Non applicabile.

● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Non applicabile.

● **In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?**

Non applicabile.

*In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Non applicabile.

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

— — Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*

Non applicabile.



**In che modo questo prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

Non applicabile.



**Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?**

Non applicabile.

L'elenco include gli investimenti che costituiscono **la quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: 01.07.2022 – 30.06.2023



**Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?**

Non applicabile.

● **Qual è stata l'asset allocation?**

L'**Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.

Non applicabile.

Non applicabile.

**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?**

Non applicabile.



**In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.

● **Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE?<sup>1</sup>**



Sì:



In gas fossile



In energia nucleare



No

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, riflette il livello di "greenness" delle società partecipate attualmente.
- **spese in conto capitale** (CapEx), evidenzia gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad es. per la transizione all'economia green.
- **spese operative** (OpEx), che riflettono le attività operative green delle società partecipate.

*I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.*

Non applicabile.

\* Per le finalità di questi grafici, "titoli sovrani" comprende tutte le esposizioni sovrane.

<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

- **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Non applicabile.

- **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

Non applicabile.



- **Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.



- **Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

Non applicabile.



- **Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**

Non applicabile.



- **Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Non applicabile.



- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile. Il prodotto finanziario non ha indicato un indice come benchmark di riferimento per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Comparto.

- **In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?**

Non applicabile.

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Nome del prodotto:

Identificativo della persona giuridica (LEI):

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund

529900HXPLSW0P5FXM28

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

### Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?

**Sì**

**No**

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale**: \_\_\_\_\_%

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

Ha effettuato **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale**: \_\_\_\_\_%

Ha **promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S)** e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del \_\_\_\_\_% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo sociale

Ha promosso caratteristiche E/S, ma **non ha effettuato investimenti sostenibili**

**La Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche sostenibili dal punto di vista sociale. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.



## In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto “onemarkets Pictet Global Opportunities Allocation Fund” (il “Comparto”) è stato lanciato il 30 giugno 2023 e non ha effettuato alcun investimento nel periodo di riferimento (1 luglio 2022 – 30 giugno 2023). Pertanto il Responsabile non ha potuto promuovere alcuna delle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto, né raggiungere durante il periodo di riferimento la prevista allocazione degli investimenti indicata nel documento informativo precontrattuale del Comparto.

Le seguenti domande non erano applicabili al termine del periodo di riferimento.

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Non applicabile.

● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

Non applicabile.

● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Non applicabile.

● **In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?**

Non applicabile.

*In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Non applicabile.

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

— — Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:

Non applicabile.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



**In che modo questo prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

Non applicabile.



**Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?**

Non applicabile.

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la **quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: 01.07.2022 – 30.06.2023



**Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?**

Non applicabile.

● **Qual è stata l'asset allocation?**

L'**Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.



Non applicabile.

Non applicabile.

**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?**

Non applicabile.



**In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.

● **Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE?<sup>1</sup>**



Sì:



In gas fossile



In energia nucleare



No

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, riflette il livello di "greenness" delle società partecipate attualmente.
- **spese in conto capitale** (CapEx), evidenzia gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad es. per la transizione all'economia green.
- **spese operative** (OpEx), che riflettono le attività operative green delle società partecipate.

*I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.*

Non applicabile.

\* Per le finalità di questi grafici, 'titoli sovrani' comprende tutte le esposizioni sovrane.

<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

- **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Non applicabile.

- **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

Non applicabile.



**Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.



**Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

Non applicabile.



**Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**

Non applicabile.



**Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Non applicabile.



**Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile. Il prodotto finanziario non ha indicato un indice come benchmark di riferimento per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Comparto.

- **In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?**

Non applicabile.

**Modello di informativa periodica per i prodotti finanziari di cui all'Articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2a, del Regolamento (UE) 2019/2088 e all'Articolo 6, primo paragrafo, del Regolamento (UE) 2020/852**

Nome del prodotto:

Identificativo della persona giuridica (LEI):

onemarkets VP Global Flexible  
Bond Fund

529900RCOUKJJ7AJU273

Per **Investimento sostenibile** si intende un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, purché l'investimento non arrechi un danno significativo ad alcun obiettivo ambientale o sociale e le società partecipate seguano buone pratiche di governance.

La **Tassonomia UE** è un sistema di classificazione istituito dal Regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale**. Il Regolamento non prevede un elenco di attività economiche sostenibili dal punto di vista sociale. Investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero essere allineati o meno alla Tassonomia.

## Caratteristiche ambientali e/o sociali

### Il prodotto finanziario aveva un obiettivo di investimento sostenibile?

**Sì**

**No**

**Ha effettuato investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale:** %

in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

**Ha effettuato investimenti sostenibili con un obiettivo sociale:** %

**Ha promosso caratteristiche Ambientali/Sociali (E/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, aveva una quota del \_\_\_% di investimenti sostenibili**

con un obiettivo ambientale in attività economiche che si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non si qualificano come sostenibili dal punto di vista ambientale secondo la Tassonomia dell'UE

con un obiettivo sociale

**Ha promosso caratteristiche E/S, ma non ha effettuato investimenti sostenibili**



## In che misura sono state conseguite le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto “onemarkets VP Global Flexible Bond Fund” (il “Comparto”) è stato lanciato il 30 giugno 2023 e non ha effettuato alcun investimento nel periodo di riferimento (1 luglio 2022 – 30 giugno 2023). Pertanto il Responsabile non ha potuto promuovere alcuna delle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal Comparto, né raggiungere durante il periodo di riferimento la prevista allocazione degli investimenti indicata nel documento informativo precontrattuale del Comparto.

Le seguenti domande non erano applicabili al termine del periodo di riferimento.

Gli **indicatori di sostenibilità** misurano come vengono raggiunte le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Qual è stato l'andamento degli indicatori di sostenibilità?**

Non applicabile.

● **... e rispetto ai periodi precedenti?**

Non applicabile.

● **Quali erano gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario ha effettuato parzialmente e in che modo l'investimento sostenibile ha contribuito a tali obiettivi?**

Non applicabile.

● **In che modo gli investimenti sostenibili effettuati parzialmente dal prodotto finanziario non hanno arrecato danni significativi ad alcun obiettivo di investimento sostenibile ambientale o sociale?**

Non applicabile.

*In che modo sono stati presi in considerazione gli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Non applicabile.

Per **principali effetti negativi** si intendono gli impatti negativi più significativi delle decisioni di investimento su fattori di sostenibilità relativi ad aspetti ambientali, sociali e che riguardano i dipendenti, il rispetto dei diritti umani e aspetti relative alla lotta alla corruzione e alla concussione.

— — Gli investimenti sostenibili erano allineati alle Linee Guida OCSE per le Imprese Multinazionali e ai Principi guida delle Nazioni Unite su Imprese e Diritti umani? Dettagli:

Non applicabile.

*La Tassonomia UE stabilisce il principio del "non arrecare danni significativi", in base al quale gli investimenti allineati con la Tassonomia non devono danneggiare in modo significativo gli obiettivi della Tassonomia UE e si accompagna a criteri specifici della UE.*

Il principio del "non arrecare danni significativi" si applica solo a quegli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale. Gli investimenti sottostanti la restante parte del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri UE per attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

*Qualsiasi altro investimento sostenibile non deve inoltre danneggiare in modo significativo alcun obiettivo ambientale o sociale.*



**In che modo questo prodotto finanziario ha considerato i Principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?**

Non applicabile.



**Quali sono stati i principali investimenti di questo prodotto finanziario?**

Non applicabile.

L'elenco include gli investimenti che costituiscono la **quota maggiore di investimenti** del prodotto finanziario durante il periodo di riferimento, che va: 01.07.2022 – 30.06.2023



**Qual è stata l'incidenza degli investimenti correlati alla sostenibilità?**

Non applicabile.

L'**Asset allocation** descrive la quota di investimenti in asset specifici.

● **Qual è stata l'asset allocation?**

Non applicabile.

Non applicabile.

**1 In linea con le caratteristiche E/S** include gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per raggiungere le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

**2 Altri** include i restanti investimenti del prodotto finanziario che non sono allineati con le caratteristiche ambientali o sociali né si qualificano come investimenti sostenibili.

● **In quali settori economici sono stati effettuati gli investimenti?**

Non applicabile.



**In che misura gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale erano allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.

● **Il prodotto finanziario ha investito in attività correlate a gas fossile e/o energia nucleare nel rispetto della Tassonomia UE?<sup>1</sup>**



Sì:



In gas fossile



In energia nucleare



No

Le attività allineate con la tassonomia sono espresse come percentuale di:

- **fatturato**, riflette il livello di "greenness" delle società partecipate attualmente.
- **spese in conto capitale** (CapEx), evidenzia gli investimenti green effettuati dalle società partecipate, ad es. per la transizione all'economia green.
- **spese operative** (OpEx), che riflettono le attività operative green delle società partecipate.

*I grafici riportati di seguito mostrano in verde la percentuale di investimenti in linea con la Tassonomia UE. Poiché non esiste una metodologia appropriata per determinare l'allineamento tassonomico dei titoli sovrani\*, il primo grafico mostra l'allineamento tassonomico in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario, inclusi i titoli sovrani, mentre il secondo mostra l'allineamento tassonomico solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dai titoli sovrani.*

Non applicabile.

\* Per le finalità di questi grafici, "titoli sovrani" comprende tutte le esposizioni sovrane.

<sup>1</sup> Attività correlate al gas fossile e/o al nucleare saranno in linea con la Tassonomia UE solo ove contribuiscano a limitare il cambiamento climatico ("mitigazione del cambiamento climatico") e non arrechino un danno significativo ad alcun obiettivo della Tassonomia UE - si veda la nota esplicativa a sinistra. Tutti i criteri relativi ad attività economiche correlate al gas fossile e all'energia nucleare che rispettano la Tassonomia UE sono illustrati nel regolamento delegato della Commissione (UE) 2022/1214.

- **Qual è stata la quota di investimenti in attività transitorie e abilitanti?**

Non applicabile.

- **Come si è rapportata la quota di investimenti allineati con la Tassonomia UE rispetto a periodi precedenti?**

Non applicabile.



**Qual è stata la quota di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale non allineati con la Tassonomia UE?**

Non applicabile.



**Qual è stata la quota di investimenti socialmente sostenibili?**

Non applicabile.



**Quali investimenti erano inclusi in “Altri”, qual era il loro scopo ed erano previste tutele ambientali o sociali minime?**

Non applicabile.



**Quali azioni sono state intraprese per soddisfare le caratteristiche ambientali e/o sociali durante il periodo di riferimento?**

Non applicabile.



**Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile. Il prodotto finanziario non ha indicato un indice come benchmark di riferimento per il raggiungimento delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse dal Comparto.

- **In che modo il benchmark di riferimento si differenzia da un indice generale di mercato?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario riguardo agli indicatori di sostenibilità per stabilire l'allineamento del benchmark di riferimento alle caratteristiche ambientali o sociali promosse?**

Non applicabile.

- **Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto al benchmark di riferimento?**

Non applicabile.



- ***Qual è stata la performance di questo prodotto finanziario rispetto all'indice generale di mercato?***

Non applicabile.



Structured Invest S.A.



Indirizzo  
8-10, rue Jean Monnet  
L-2180 Lussemburgo