

#### Info fondo

|                       |                                 |
|-----------------------|---------------------------------|
| Gestore               | Luca Massimiliano Orioli        |
| AUM comparto (Mln €)  | 53,14 €                         |
| Distribuzioni (Mln €) | 0,00 €                          |
| Valuta di riferimento | Euro €                          |
| Frequenza NAV         | Giornaliera                     |
| Tipo di OICR          | Fondo di diritto italiano UCITS |
| Domicilio             | Italy                           |
| Depositaria           | BNP Paribas                     |
| Revisore              | Deloitte                        |
| Indicatore di rischio | 2/7                             |
| SFDR                  | Art. 6                          |

#### Info classe

|                             |                       |
|-----------------------------|-----------------------|
| NAV (Valore quota)          | 101,11                |
| Distribuzioni per quota (€) | 0 €                   |
| Data di lancio              | 2025-10-06            |
| ISIN Code                   | IT0005666604          |
| Bloomberg ticker            | ANSPORB IM            |
| Management fee (%)          | 0.7                   |
| Performance fee (%)         | 10                    |
| Minimum investment          | 1000                  |
| Contatti                    | marketing@anthilia.it |
| Website                     | www.anthilia.it       |

#### Politica di investimento

Anthilia Spread Opportunity 2029 investe in un portafoglio obbligazionario diversificato tra diverse tipologie di bond tra loro poco correlate: dai bond high yield alle obbligazioni di emittenti finanziari, dai governativi dei Paesi Emergenti ai governativi dell'Area Euro, fino ad asset class obbligazionario specializzate (come gli Insurance Linked Securities e alcune tipologie di ABS/MBS). L'orizzonte temporale di investimento è il 2029 (4 anni). Il fondo distribuisce annualmente una cedola commisurata al rendimento cedolare implicito del portafoglio.

#### Esposizione per Paese

|                 |        |
|-----------------|--------|
| Paese d'origine | Peso   |
| Italia          | 24,06% |

\* solo portafoglio obbligazionario

#### Esposizione per rating

|           |        |
|-----------|--------|
| Rating    | Peso   |
| BBB       | 15,66% |
| BBB-      | 2,17%  |
| BB        | 5,46%  |
| Withdrawn | 0,77%  |

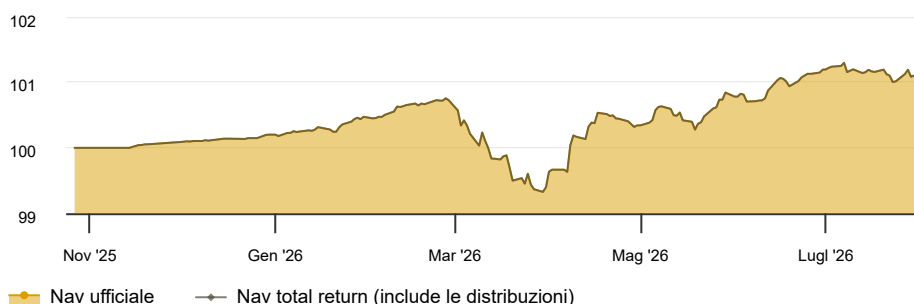
\* solo portafoglio obbligazionario

|                           |      |
|---------------------------|------|
| Duration portafoglio bond | 1,83 |
|---------------------------|------|

#### Esposizione valutaria

|        |         |
|--------|---------|
| Valuta | Peso    |
| EUR    | 100,00% |

#### Performance dal lancio



#### Rendimenti mensili

| Anno | Gen  | Feb  | Mar   | Apr  | Mag  | Giu  | Lug   | Ago | Set | Ott  | Nov  | Dic  | Tot  |
|------|------|------|-------|------|------|------|-------|-----|-----|------|------|------|------|
| 2025 | -    | -    | -     | -    | -    | -    | -     | -   | -   | 0,00 | 0,08 | 0,12 | 0,20 |
| 2026 | 0,27 | 0,25 | -1,32 | 0,95 | 0,50 | 0,35 | -0,09 | -   | -   | -    | -    | -    | 0,90 |

#### Rendimenti mensili total return

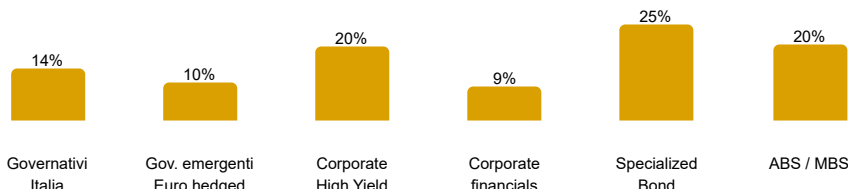
| Anno | Gen  | Feb  | Mar   | Apr  | Mag  | Giu  | Lug   | Ago | Set | Ott  | Nov  | Dic  | Tot  |
|------|------|------|-------|------|------|------|-------|-----|-----|------|------|------|------|
| 2025 | -    | -    | -     | -    | -    | -    | -     | -   | -   | 0,00 | 0,08 | 0,12 | 0,20 |
| 2026 | 0,27 | 0,25 | -1,32 | 0,95 | 0,50 | 0,35 | -0,09 | -   | -   | -    | -    | -    | 0,90 |

#### Analisi delle performance total return

|                           |       |                           |        |
|---------------------------|-------|---------------------------|--------|
| Rendimento da inizio anno | 0,90% | Volatilità annualizzata   | 1,16%  |
| Rendimento dal lancio     | 1,11% | Massimo drawdown          | -1,42% |
| Alpha*                    | 0,00% | Tempo di recupero (mesi)  | 2,00   |
| Beta*                     | 0,00  | Correlazione col mercato* | 0,00   |

\* statistiche di confronto calcolate in riferimento all'indice governativo europeo 3-5Y

#### Composizione del portafoglio



#### Esposizione obbligazionaria per emittente

| Emittente                               | Peso   |
|-----------------------------------------|--------|
| REPUBBLICA ITALIANA                     | 14,10% |
| FINCOBANK BANCA FINECO S.P.A. O IN...   | 1,25%  |
| UNIPOL ASSICURAZIONI S.P.A.             | 1,23%  |
| INTESA SANPAOLO SPA                     | 1,21%  |
| BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA S.P...  | 1,04%  |
| BPER BANCA S.P.A.                       | 0,98%  |
| ASSICURAZIONI GENERALI SOCIETA PER ...  | 0,97%  |
| UNICREDIT, SOCIETA PER AZIONI IN FOR... | 0,96%  |
| BANCA SELLA HOLDING S.P.A.              | 0,94%  |
| CASSA DI RISPARMIO DI BOLZANO S.P.A.    | 0,77%  |

#### Top holdings

| Descrizione                       | Peso   |
|-----------------------------------|--------|
| GAM STAR-CAT BOND FUND-INACEUR    | 15,65% |
| AEGON EUROPEAN ABS FUND-IACC      | 11,24% |
| SCOR ATROPOS CATBOND-B2 EURO      | 9,75%  |
| AMUNDI ABS-I                      | 9,19%  |
| L&G EMR MRKT GB 0-5Y SCR-EUR      | 8,25%  |
| CANDR BONDS-GLB HIGH YLD-I-C      | 7,00%  |
| DEU EURO HIGH YLD CP-IC EUR       | 6,46%  |
| IMGP EUROPE HH YD FD-I S EUR      | 6,26%  |
| ITALY BTP FUTURA 20-14/07/2030 SR | 3,90%  |
| BTP VALORE 24-14/05/2030 SR       | 3,55%  |