

ANTHILIA STEP IN

INFORMATIVA SULLA SOSTENIBILITÀ

Ai sensi dell'art.10 del Regolamento (UE) 2019/2088 e degli artt. 25-36 del Regolamento Delegato (UE) 2022/2188

1) Sintesi

“Anthilia Step In” è un Fondo comune di investimento mobiliare di diritto italiano di tipo aperto, istituito in data 28 marzo 2025, ai sensi della Direttiva 2009/65/CE, che rientra nella categoria di cui all'art 8 del Regolamento (UE) 2019/2088 (“Sustainable Finance Disclosure Regulation” o “SFDR”).

Anthilia Step In promuove caratteristiche ambientali o sociali, o una combinazione di tali caratteristiche, senza perseguire un obiettivo di investimento sostenibile.

2) Nessun obiettivo di investimento sostenibile

Il Fondo Anthilia Step In promuove caratteristiche ambientali o sociali, ma non ha come obiettivo un investimento sostenibile.

3) Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario

Il Fondo promuove caratteristiche ambientali e sociali in linea con i più elevati standard internazionali, in particolare con riferimento:

- alle **caratteristiche ambientali**, contribuendo alla prevenzione e riduzione dell'inquinamento attraverso il sostegno a iniziative che favoriscano l'adozione di fonti energetiche pulite e accessibili, nonché promuovendo la transizione verso un modello di economia circolare mediante l'investimento in attività imprenditoriali innovative ed in infrastrutture sostenibili, favorendo altresì pratiche di consumo e produzione responsabili.
- alle **caratteristiche sociali**, sostenendo la creazione di occupazione stabile nel rispetto dei diritti fondamentali dei lavoratori e promuovendo politiche di inclusione sociale con particolare attenzione alla parità di genere.

4) Strategia di investimento

La SGR intende gestire il Fondo con l'obiettivo di incrementare il valore del suo patrimonio gradualmente in un orizzonte temporale di medio periodo, e con un profilo di rischio medio, nonché distribuire una cedola semestrale.

La SGR integra i principi ambientali, sociali e di *governance* (ESG) nella propria attività di investimento.

Al fine di verificare il rispetto delle prassi di buona *governance*, nella selezione degli investimenti, la SGR può effettuare valutazioni interne anche sulla base delle informazioni ottenute in occasione di possibili incontri con le imprese e/o i gestori degli OICR oggetto di investimento.

Per promuovere le caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario, la SGR seleziona prevalentemente investimenti in altri OICR, ivi inclusi gli ETF, che sono classificati tra i prodotti conformi ai sensi dell'articolo 8 SFDR (i.e. prodotti che promuovono caratteristiche A/S) e/o dell'articolo 9 SFDR (i.e. prodotti finanziari che hanno come obiettivo investimenti sostenibili) che di seguito si definiscono "OICR art. 8 e/o art. 9 SFDR".

Le caratteristiche A/S del Fondo sono perseguite attraverso:

- Screening negativi: la SGR utilizza criteri finalizzati ad escludere le imprese coinvolte in specifiche attività o specifici settori ritenuti non finanziabili in linea con i divieti e le limitazioni stabiliti dalla vigente *Policy ESG* adottata dalla SGR che definisce in modo puntuale i criteri di esclusione e disciplina i settori e le attività non ammissibili in ossequio alla normativa applicabile e ai principi di sostenibilità (*best practice*) riconosciuti a livello internazionale;
- Screening positivi: nelle decisioni di investimento sono tenuti in considerazione criteri funzionali a valutare l'allineamento del potenziale investimento rispetto agli obiettivi ambientali o sociali individuati dalla SGR.

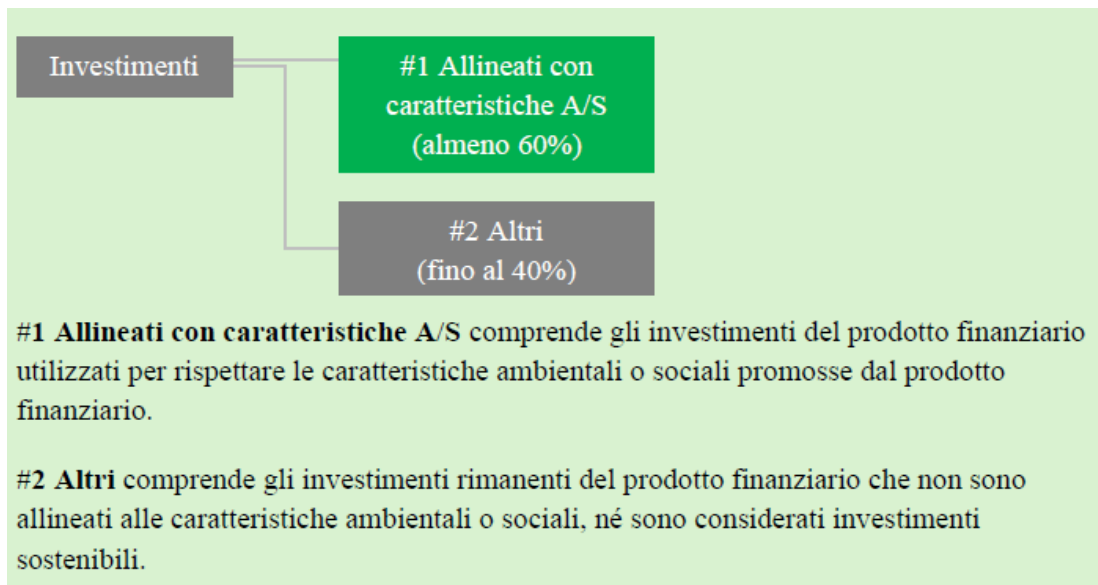
In particolare, il Fondo privilegia gli investimenti in strumenti finanziari che adottano strategie e politiche orientate a:

- **migliorare le performance ambientali**, attraverso la riduzione di emissioni, la transizione a fonti di energia rinnovabili, l'uso responsabile ed efficiente delle risorse, l'adozione di modelli di economia circolare;
- **promuove il benessere sociale**, attraverso la creazione e il mantenimento di posti di lavoro, il rispetto di condizioni di lavoro eque e sicure, l'adozione di politiche a favore delle diversità e dell'inclusione, lo sviluppo delle comunità locali.

Nel caso di investimenti in parti di OICR, la SGR, nell'ambito del processo di selezione, valuta le caratteristiche ambientali e/o sociali promosse e le strategie di investimento sostenibile adottate dai gestori degli OICR art. 8 e/o art. 9 SFDR oggetto di analisi.

5) Quota degli investimenti

Il Fondo si impegna ad effettuare, nel rispetto degli elementi vincolanti delineati nella strategia e nella politica di investimento, almeno il 60% degli investimenti «Allineati con caratteristiche ambientali e/o sociali» (#1)



6) Monitoraggio delle caratteristiche ambientali o sociali

Gli indicatori di sostenibilità utilizzati per verificare la promozione delle caratteristiche ambientali o sociali che Anthilia Step In intende realizzare sono monitorati lungo l'intero ciclo di vita dell'investimento e rendicontati annualmente.

7) Metodologie

L'attenta adesione alla lista di esclusione garantisce una totale eliminazione dell'esposizione a settori e società specifici. In aggiunta agli *screening negativi*, la SGR effettua *screening positivi* per valutare l'allineamento del potenziale investimento rispetto agli obiettivi ambientali e sociali individuati dalla stessa.

8) Fonti e trattamento dei dati

La SGR svolge un'attività di approfondimento sugli OICR art. 8 e/o art. 9 SFDR oggetto di un possibile investimento e sul gestore degli stessi, al fine di poterne verificare la conformità in termini di caratteristiche ambientali e/o sociali con quanto espresso dal Regolamento del Fondo.

A questo fine si procede con l'analisi della documentazione prodotta dal gestore terzo; a titolo esemplificativo si fa riferimento a presentazioni relative all'OICR oggetto del potenziale investimento, al regolamento o allo statuto e, ove disponibile, al prospetto dell'OICR, ai dati che il gestore scambia con i distributori e investitori tramite file EET (cd. *European ESG Template*), alla policy ESG adottata dal gestore e all'eventuale *score* ESG attribuito all'OICR da parte di data provider specializzati.

9) Limitazioni delle metodologie e dei dati

Le metodologie utilizzate seguono le migliori pratiche di mercato attualmente disponibili. Le principali limitazioni dei metodi di analisi sopra descritti sono rappresentate dal grado di copertura degli emittenti in portafoglio da parte dei fornitori esterni e dalla disomogeneità dei sistemi di misurazione. La SGR non prevede comunque limitazioni tali da inficiare il rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Fondo.

10) Dovuta Diligenza

Nell'ambito del processo di investimento adottato dalla SGR, la valutazione dei potenziali investimenti del Fondo è effettuata mediante lo svolgimento di attività di *due diligence* che prevedono *screening* negativi e *screening* positivi finalizzati a scegliere OICR che contribuiscono alle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Fondo.

11) Politiche di impegno

La Società non prevede l'adozione di politiche di impegno da attuare durante la gestione degli investimenti sottostanti.

12) Indice di riferimento designato

Attualmente non applicabile perché non è stato designato un indice di riferimento comparabile con le caratteristiche del Fondo. Nelle relazioni periodiche del Fondo sarà indicata la misura in cui le caratteristiche ambientali o sociali sono conseguite.