

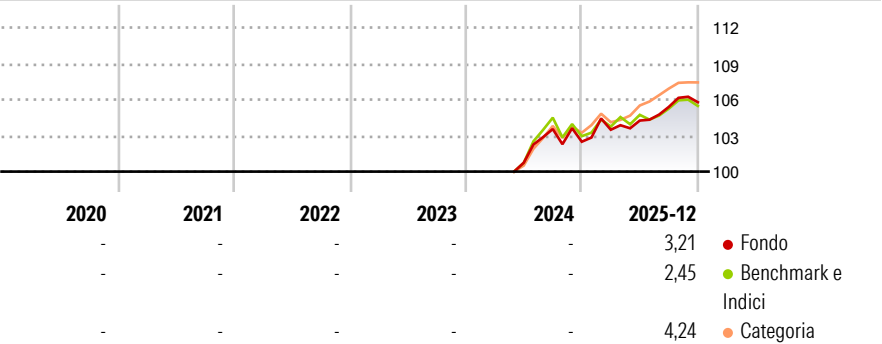
Ellipsis Optimal Allocation Credit EBEUR

|  |  |                                      |                            |
|--|--|--------------------------------------|----------------------------|
| <b>Categoria Morningstar™</b>                  | <b>Benchmark Morningstar</b>                                   | <b>Benchmark Dichiarato</b>          | <b>Morningstar Rating™</b> |
| Obbligazionari Flessibili Globali - EUR Hedged | Morningstar Global Core Bond GR Hedged EUR<br>Usato nel Report | Bloomberg Global Agg Corp TR Hdg EUR | Senza rating               |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

-

Rendimenti



Misure di Rischio

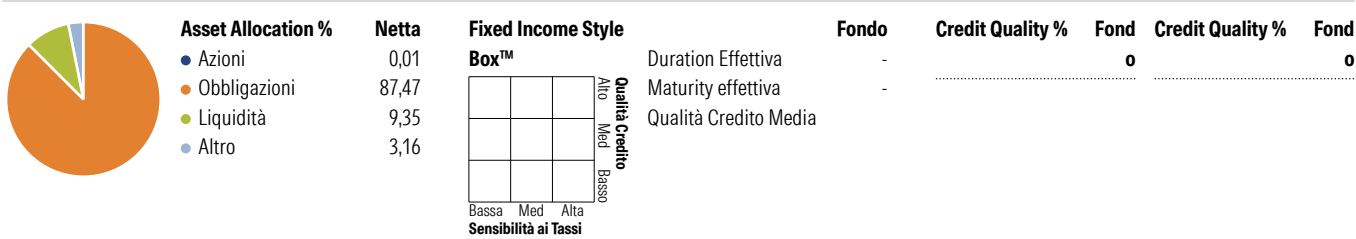
|                   |   |                 |   |
|-------------------|---|-----------------|---|
| 3Y Alpha          | - | 3Y Sharpe Ratio | - |
| 3Y Beta           | - | 3Y Std Dev      | - |
| 3Y R-Squared      | - | 3Y Risk         | - |
| 3Y Info Ratio     | - | 5Y Risk         | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk        | - |

Basati su Morningstar Global Core Bond GR Hedged EUR (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat  | Rendimenti Trimestrali % | Q1   | Q2   | Q3   | Q4    |
|------------------|-------|-------|------|--------------------------|------|------|------|-------|
| 3-Mesi           | 0,21  | -0,26 | 0,68 | 2026                     | -    | -    | -    | -     |
| 6-Mesi           | 2,30  | 0,81  | 2,16 | 2025                     | 0,98 | 0,74 | 1,09 | 0,37  |
| 1-Anno           | 4,73  | 2,09  | 4,38 | 2024                     | -    | -    | 2,78 | -1,02 |
| 3-Anni Ann.ti    | -     | -     | -    | 2023                     | -    | -    | -    | -     |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | -     | -    | 2022                     | -    | -    | -    | -     |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -     | -    |                          |      |      |      |       |

Rendimenti aggiornati al 14/01/2026

Portafoglio 28/02/2025



| Titoli principali                           |         |       |
|---|---------|-------|
| Nome  | Settore | %     |
| United States Treasury Notes...             | —       | 23,67 |
| Ellipsis High Yield Fund Z                  | —       | 9,87  |
| Germany (Federal Republic...                | —       | 9,57  |
| France (Republic Of) 0%                     | —       | 7,31  |
| United Kingdom of Great...                  | —       | 5,01  |
| United States Treasury Bonds...             | —       | 4,23  |
| Germany (Federal Republic...                | —       | 3,88  |
| United States Treasury Bonds...             | —       | 3,84  |
| HelloFresh SE 0.75%                         | —       | 1,89  |
| United States Treasury Notes...             | —       | 1,25  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 70,52 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 47    |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo | Scadenze % | Fondo |
|----------------------------------|-------|------------|-------|
| Governativo                      | 61,97 | da 1 a 3   | 4,43  |
| Societario                       | 35,99 | da 3 a 5   | 22,14 |
| Cartolarizzazioni                | 0,00  | da 5 a 7   | 6,34  |
| Enti Locali                      | 0,00  | da 7 a 10  | 46,25 |
| Liquidità ed equivalenti         | 1,88  | da 10 a 15 | 0,00  |
| Derivati                         | 0,16  | da 15 a 20 | 0,00  |
|                                  |       | da 20 a 30 | 8,91  |
|                                  |       | oltre 30   | 8,80  |
| Coupon Range %                   | Fondo |            |       |
| 0 coupon                         | 0,60  |            |       |
| Da 0 a 4 cedole                  | 56,68 |            |       |
| Da 4 a 6 cedole                  | 24,73 |            |       |
| Da 6 a 8 cedole                  | 15,31 |            |       |
| Da 8 a 10 cedole                 | 2,61  |            |       |
| Da 10 a 12 cedole                | 0,07  |            |       |
| Oltre 12 cedole                  | 0,00  |            |       |

Anagrafica

|                        |                           |                         |              |                              |        |
|------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|--------|
| Società di Gestione    | Ellipsis Asset Management | Patrimonio Classe (Mln) | 0,01 EUR     | Investimento Min. Ingresso   | -      |
| Telefono               | -                         | (14/01/2026)            |              | Investimento Min. Successivo | -      |
| Web                    | www.ellipsis-am.com       | Domicilio               | FRANCIA      | T.E.R.                       | -      |
| Data di Partenza       | 14/05/2024                | Valuta del Fondo        | EUR          | Spese correnti               | -      |
| Nome del Gestore       | Nicolas Blanc             | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | 15,00% |
| Data Inizio Gestione   | 14/07/2014                | Inc/Acc                 | Acc          |                              |        |
| NAV (14/01/2026)       | EUR 10.603,86             | ISIN                    | FR001400P058 |                              |        |
| Patrimonio Netto (Mln) | 79,22 EUR                 |                         |              |                              |        |

(28/02/2025)