Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Blue
Planetarium Sicav
Fondo Global Macro

Weekly Report **24 gennaio 2020**
www.anthilia.it

AnthiliaBlue

Anthilia Blue

Gestori	Andrea Cuturi | Giuseppe Sersale
AUM comparto (Mln €)	20,5
Valuta di riferimento	Euro €
Frequenza del NAV	Quotidiano
Tipo di OICR	SICAV UCITS V
Domicilio	Lussemburgo
Depositaria	RBC Investor Services
Revisore	EY
Management fee (%) A	1,45
Management fee (%) B	0,95
Perfomance fee (%)	20 (high watermark perpetuo)
Investimento minimo	Nessuno classe A € 250.000 classe B
AUM SGR (Mln €)	737,7626576

Classe B (Istituzionale)

NAV (Valore quota)	**101,01**
Data di lancio	28 novembre 2008
ISIN code	LU0374938057
Bloomberg ticker	PLANTBB LX
Contatti	info@anthilia.it | www.anthilia.it
Swiss Representative:	ACOLIN Fund Services AG
Swiss Paying Agent:	PKB Privatbank AG
Publications:	www.fundinfo.com

Profilo di rischio

Basso rischio — Alto rischio

1 2 3 4 5 6 7

Rischio medio/basso

Politica d'Investimento

Stile di gestione flessibile. Obiettivo del fondo è generare rendimenti positivi diversificando le classi di investimento. Il portafoglio seleziona azioni prevalentemente europee, in base ad un'analisi di tipo fondamentale, e le combina con titoli di stato, obbligazioni corporate, indici azionari e futures sui cambi. Andrea Cuturi, gestore di Anthilia Blue, ha una lunga esperienza internazionale nella gestione finanziaria. Sono esclusi dalla politica d'investimento titoli derivati non quotati. Gli investimenti azionari su singoli titoli si rivolgono prevalentemente a società con elevata capitalizzazione. Gli investimenti obbligazionari sono selezionati fra gli emittenti governativi, sovranazionali o corporate con rating pari almeno a investment grade. L'investimento in covered warrants e in asset backed securities (ABS) è escluso. Il comparto può investire in quote di altri fondi nel limite del 10% del patrimonio. Ai fini di copertura del rischio di cambio, gli investimenti in divise diverse dall'euro potranno essere coperti. Il comparto può ricorrere a strumenti finanziari derivati con finalità di copertura dei rischi, di gestione efficiente del portafoglio e di investimento. Il rischio globale connesso agli strumenti finanziari derivati non può superare il valore del patrimonio netto del comparto. È escluso l'investimento in derivati di credito. Le modalità d'investimento permettono una liquidabilità giornaliera totale del portafoglio.

Esposizione settoriale azionaria

Settore	Peso (%)
Nonlife Insurance	0,27

Esposizione geografica azionaria (primi 3)

Paese d'origine	Peso (%)
ITALY	0,27

Portafoglio obbligazionario

Duration portafoglio bond	-1,26

Esposizione valutaria

Valuta	Peso (%)
EUR	107,6
CHF	0,0
GBP	1,8
USD	-15,7
JPY	6,4

NAV dal lancio

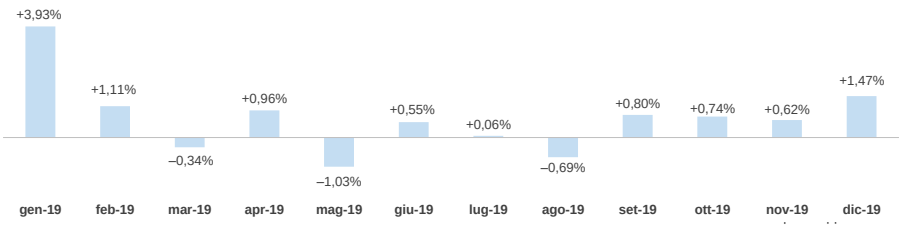
Rendimenti mensili (%)

	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Anno
2008	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	–1,01	**N.D.**
2009	+0,25	+0,25	+0,07	+1,12	+0,06	–0,50	+0,23	+0,68	+0,95	+0,39	+0,01	+0,34	**+3,90**
2010	–1,15	–0,53	+0,49	+0,84	–0,25	+0,59	–0,77	+1,10	+0,24	+0,19	+0,83	+1,20	**+2,79**
2011	–1,34	–0,33	+0,14	+0,01	+0,40	–0,98	–0,25	–2,26	–2,43	+2,02	–4,00	+0,51	**–8,32**
2012	+4,11	+2,56	–0,72	–2,75	–2,33	–0,26	+2,66	+1,81	+2,09	+0,99	+0,32	+1,05	**+9,70**
2013	+1,56	–2,55	+0,20	+0,43	+0,19	–1,52	+0,84	+0,40	–0,02	+1,33	+1,51	–1,07	**+1,23**
2014	–0,19	+1,00	+0,20	–0,46	+0,13	+0,00	–0,51	–0,32	+0,16	–1,46	+1,21	+0,75	**+0,47**
2015	+5,18	+4,18	+1,71	–1,85	–1,13	–3,15	+2,71	–2,75	–3,13	+5,05	+1,50	–2,45	**+5,40**
2016	–3,60	–1,63	+1,50	+2,01	–0,02	–3,02	+1,87	+1,26	–0,63	+2,86	–1,49	+2,85	**+1,69**
2017	–0,27	–0,37	+0,14	+0,55	–0,36	–0,56	–0,18	–1,25	+1,48	+0,82	–0,49	–1,14	**–1,66**
2018	+0,22	–0,06	–2,46	+1,80	–0,43	–0,48	+0,92	–1,77	+1,58	–3,31	–0,01	–3,79	**–7,70**
2019	+3,93	+1,11	–0,34	+0,96	–1,03	+0,55	+0,06	–0,69	+0,80	+0,74	+0,62	+1,47	**+8,40**
2020	–1,21												

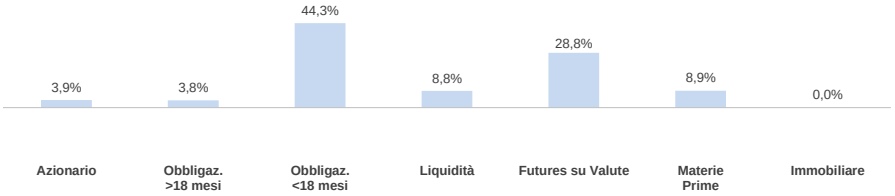
Analisi della performance

Rendimento da inizio anno	–1,21%	Volatilità annualizzata	5,66%
Rendimento dal lancio	+12,63%	VaR mensile 99%	1,57%
Sharpe ratio	0,16	Massimo drawdown	–14,02%
Alpha	–0,29%	Tempo di recupero (mesi)	-
Beta	0,19	Correlazione col mercato	0,68

Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio



Composizione azionaria

Dettaglio del portafoglio azionario

Descrizione titolo	(%)
FTSE 100 FUT MAR20	7,35
RUSSELL 2000 MINI MAR20	5,22
EURO STOXX 50 MAR20	2,19
NET INSURANCE SPA	0,27
NASDAQ 100 E-MINI FUT MAR20	-2,45
FTSE/MIB FUT MAR20	-3,47
S&P500 EMINI FUT MAR20	-5,15

I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. I rendimenti sono al lordo degli oneri fiscali ed al netto degli oneri di gestione. Prima dell'adesione leggere il prospetto informativo disponibile sul sito internet della società di gestione. Si raccomanda la lettura dell'ultimo rendiconto annuale o relazione semestrale disponibile.