

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia White Planetarium Sicav Fondo Absolute Return

Anthilia White ha incorporato il comparto
Plurima Low Volatility il 21 ottobre 2011

Weekly Report 21 febbraio 2020
www.anthilia.it

LIPPER 1 5 4 3 2 1



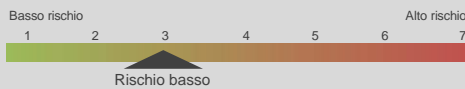
Anthilia White

Gestore AUM comparto (Mln €) Valuta di riferimento Frequenza del NAV Tipo di OICR Domicilio Depositaria Revisore Management fee (%) A Management fee (%) B Management fee (%) C Performance fee (%) Investimento minimo	Markus Ratzinger Anne-Sophie Chouillou 116,2 Euro € Quotidiana UCITS V SICAV Lussemburgo RBC Investor Services EY 1,00 0,65 0,40 20 (High Watermark perpetuo) nessuno classe A € 250.000 classe B € 5.000.000 classe C
--	---

Classe C (Istituzionale)

NAV (Valore quota) Data di lancio ISIN code Bloomberg ticker Contatti Swiss Representative: Swiss Paying Agent: Publications:	129,73 28 gennaio 2008 LU0599024741 PLANWTD LX info@anthilia.it www.anthilia.it ACOLIN Fund Services AG PKB Privatbank AG www.fundinfo.com
--	---

Profilo di rischio



Politica d'Investimento

Stile di gestione flessibile a ritorno assoluto, con volatilità massima del 3%.

Il fondo persegue i suoi obiettivi attraverso un asset allocation basata sulla massima diversificazione. Il portafoglio è costruito ricercando titoli con i migliori premi al rischio derivanti dagli scostamenti dei prezzi di mercato rispetto al loro fair value, nelle varie asset class su cui il fondo investe.

Volatilità e liquidabilità sono due parametri che incidono in modo determinante sulla scelta dei titoli. Il fondo investe in obbligazioni corporate e governative, strutturate, convertibili, ABS, commodities, azioni e certificati.

L'utilizzo di OICR è possibile fino a un massimo del 10% del patrimonio. E' ammesso l'uso di derivati a scopo di copertura.

Esposizione obbligazionaria per emittente

Emittente	Peso (%)
Mediobanca	7,35
Goldman Sachs	7,34
HSBC	7,07
IBRD	6,20
Citibank	5,66
Austria	5,33
Credit Suisse	5,23
Société Générale	4,45

Rating del portafoglio

Rating	Peso (%)
AAA	-4,16
AA	11,23
A	26,31
BBB	5,47
BB	2,24
B	0,69
CCC	0,00

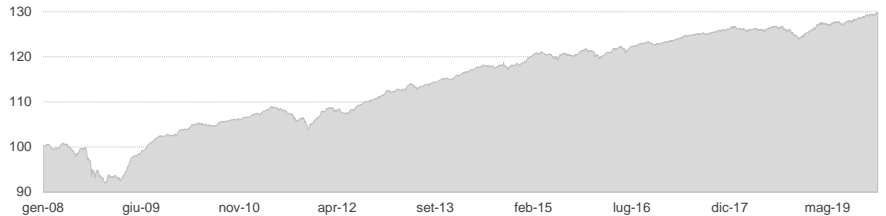
Portafoglio obbligazionario

Duration portafoglio bond	0,81
---------------------------	------

Esposizione valutaria

Valuta	Peso (%)
EUR	97,47
USD	1,04
GBP	1,49

NAV dal lancio



Rendimenti mensili (%)

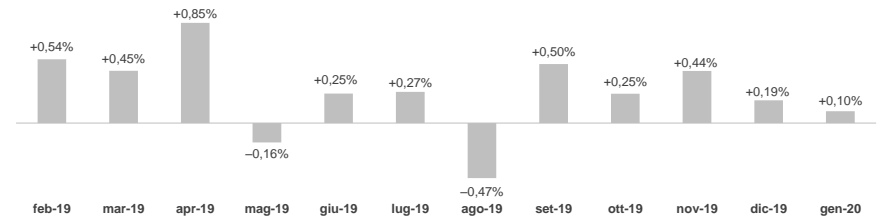
	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Anno
2008	+0,10	+0,46	-1,01	+0,84	+0,12	-1,11	-0,76	+1,05	-2,77	-3,03	-0,57	-0,47	-7,02
2009	+0,32	-0,24	+0,73	+3,26	+1,20	+1,00	+1,29	+0,96	+1,21	+0,08	-0,06	+0,12	+10,28
2010	+1,13	+0,14	+1,02	+0,29	-0,32	+0,02	-0,02	+0,78	+0,09	+0,30	+0,04	+0,38	+3,90
2011	+0,36	+0,47	+0,30	+0,50	+0,35	-0,24	-0,31	-0,65	-1,27	+0,47	-2,51	+1,92	-0,68
2012	+1,12	+1,05	+0,43	-0,29	-0,70	-0,20	+0,89	+0,98	+0,70	+0,22	+0,64	+0,50	+5,45
2013	+0,71	-0,14	+0,28	+0,55	+0,64	-0,74	+0,54	+0,18	+0,44	+0,54	+0,24	-0,05	+3,23
2014	+0,56	+0,54	+0,44	+0,45	+0,35	-0,02	+0,05	+0,11	-0,03	-0,08	+0,31	+0,23	+2,96
2015	+0,83	+0,73	+0,17	-0,07	+0,02	-0,87	+0,83	-0,04	-0,32	+0,73	+0,60	-0,28	+2,32
2016	-0,81	-0,32	+0,78	+0,71	+0,32	-0,87	+0,93	+0,25	+0,35	+0,28	-0,58	+0,06	+1,11
2017	+0,55	+0,06	+0,38	+0,47	+0,21	+0,14	+0,09	-0,09	+0,39	+0,24	+0,25	+0,07	+2,80
2018	+0,30	-0,24	-0,44	+0,30	-0,21	-0,03	+0,61	+0,17	-0,21	-0,62	-0,43	-0,96	-1,74
2019	+0,93	+0,54	+0,45	+0,85	-0,16	+0,25	+0,27	-0,47	+0,50	+0,25	+0,44	+0,19	+4,12
2020	+0,10	+0,44											+0,54

Analisi della performance

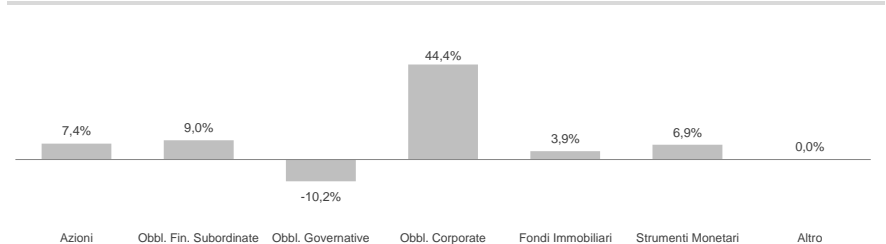
Rendimento da inizio anno	+0,54%	Correlazione col mercato	-0,05
Rendimento dal lancio	+29,73%	Alpha	1,82%
Sharpe ratio	0,94	Beta	-0,04
Volatilità annualizzata	+1,80%	Tempo di recupero (mesi)	8,20
VaR mensile 99%	+1,15%	Massimo drawdown	-8,72%

Alpha e Beta sono calcolati in riferimento all'indice Barclays Global-Aggregate TR Index Hedged

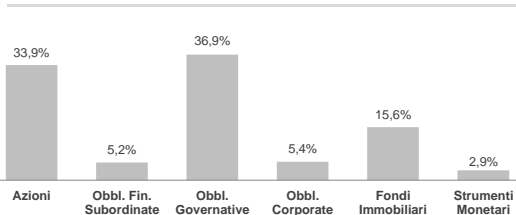
Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio



Contribuzione al rischio di portafoglio



Titoli in portafoglio (primi 10)

Descrizione titolo	(%)
HSBC BANK PLC	6,98
CITIGROUP INC 2 1/2 09/30/26	3,82
BTPS 0.4 04/11/24	3,67
AUST 0 10/10/25	3,15
IBRD 0 08/11/26	3,09
UCGIM 0 05/31/23	3,00
SOCGEN 2.85 10/31/23	2,96
BACRED 0 10/30/22	2,92
ITALY 0 06/28/29	2,90
IBRD 1.2 10/20/26	2,69

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.