

# Anthilia Capital Partners SGR

## Anthilia Yellow

### Fondo Obbligazionario Flessibile

Weekly Report 25 settembre 2020

www.anthilia.it



LIPPER 1 5 4 3 2 1 LOWEST

#### Classe A (Retail)

NAV (Valore quota) **145,06**

Gestore Markus Ratzinger  
Anne-Sophie Chouillou  
AUM comparto (Mln €) 59,4  
Data di lancio 2 luglio 2012  
Valuta di riferimento Euro €  
Frequenza del NAV Giornaliera  
Tipo di OICR SICAV UCITS V (armonizzata)  
Domicilio Lussemburgo  
Depositaria RBC Investor Services  
Revisore EY  
ISIN code LU1377525735  
Bloomberg ticker PLAYELA LX  
Management fee (%) 1,25 Classe A  
0,70 Classe B  
Performance fee (%) 20 (High Watermark perpetuo)  
Investimento minimo nessuno Classe A  
€ 250.000 Classe B

Contatti info@anthilia.it  
Sito internet www.anthilia.it

Il fondo ha cambiato nome e politica di investimento a partire dal 2 luglio 2012 - in precedenza era Profilo Elite Flessibile

#### Profilo di rischio



#### Politica d'Investimento

Comparto flessibile discrezionale, con un obiettivo di volatilità media. Il fondo mira ad incrementare il valore del capitale investito, con un orizzonte temporale di investimento di almeno tre anni. Privilegia gli investimenti in strumenti finanziari di natura obbligazionaria emessi da società del settore finanziario. Tale investimento rappresenta una porzione variabile dell'attivo del Fondo in funzione delle condizioni di mercato e coerentemente con lo stile di gestione flessibile.

#### Esposizione per emittente

Emittente	Peso (%)
HSBC	8,21
Mediobanca	5,03
AXA	4,88
Generali	3,88
Goldman Sachs	3,79
Barclays	3,57
Banca Ifis	3,45

#### Rating del portafoglio

Rating	Peso (%)
AAA	0,00
AA	-9,76
A	10,02
BBB	23,41
BB	28,06
B	2,96
CCC	1,71
NR	3,77

#### Portafoglio obbligazionario

Duration portafoglio bond 2,09

#### Esposizione valutaria

Valuta	Peso (%)
EUR	97,68
USD	1,00
GBP	1,32

#### NAV dal lancio



#### Rendimenti mensili (%)

	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Anno
2012	+4,73	+5,85	-0,22	-1,39	-1,68	+0,25	+1,05	+1,23	+2,97	+2,09	+1,67	+1,71	+19,55
2013	+0,88	+0,20	+0,29	+1,87	+0,37	-1,68	+0,98	+0,22	+0,92	+1,26	+0,38	+0,18	+5,97
2014	+1,15	+1,30	+0,35	+0,95	+0,84	+0,54	+0,03	+0,49	-0,17	+0,37	+0,52	-0,02	+6,54
2015	+1,26	+0,69	+0,37	+0,42	-0,15	-0,96	+0,81	-0,54	-0,73	+0,93	+0,42	-1,20	+1,29
2016	-1,16	-1,93	+2,40	+0,88	+0,51	-1,79	+2,02	+1,02	+0,08	+0,63	-1,17	+0,70	+2,10
2017	+1,08	+0,54	+0,41	+1,34	+0,90	+0,42	+0,51	+0,04	+0,41	+0,79	+0,17	+0,20	+7,03
2018	+0,64	-0,95	-1,12	+0,59	-1,46	-0,51	+1,25	-0,21	-0,41	-1,05	-1,14	-0,93	-5,23
2019	+1,92	+1,10	+0,27	+1,35	-0,89	+1,24	+0,44	-0,35	+0,60	+0,94	+0,64	+0,55	+8,05
2020	+0,33	-0,36	-10,67	+4,54	+1,30	+1,07	+1,09	+1,47	-0,60				-2,55

#### Analisi della performance

##### Statistiche a 1 anno

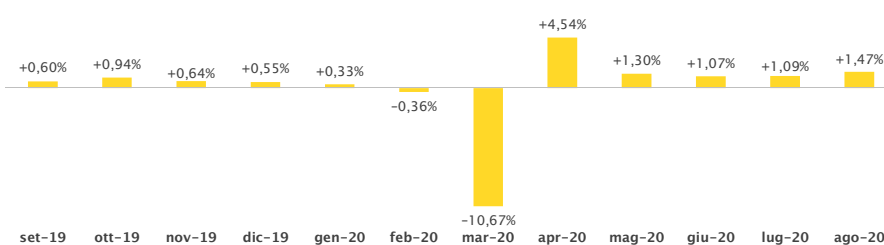
Rendimento da inizio anno	-2,55%
Sharpe ratio	-0,02
Alpha	-0,55%
Beta	0,51
Volatilità annualizzata	6,46%

Alpha e Beta sono calcolati in riferimento all'indice Iboxx Euro Financial Subordinated TR

##### Statistiche dal lancio

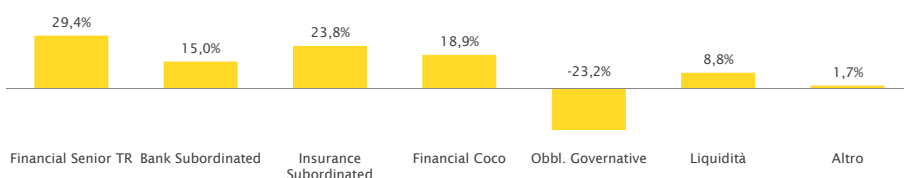
Rendimento	+38,34%
VaR mensile 99%	+4,11%
Correlazione col mercato	0,43
Massimo drawdown	-14,77%
Tempo di recupero (mesi)	-

#### Rendimenti mensili ultimi 12 mesi

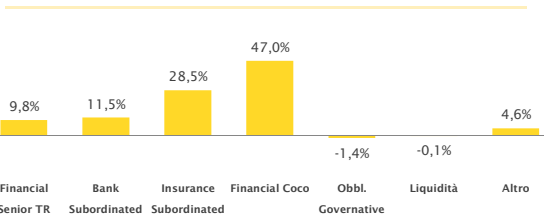


#### Composizione del portafoglio

##### Asset allocation



##### Contribuzione al rischio di portafoglio



##### Titoli in portafoglio (primi 10)

Descrizione titolo	(%)
HSBC BANK PLC	7,08
GE 0 02/16/21	3,51
AXASA 6.6862 PERP	2,73
ASSGEN 6.269 PERP	2,55
FRTR 0 1/4 11/25/20	2,53
BACRED 2 03/29/24	2,49
UCGIM 0 05/31/23	2,38
STANDARD CHART	2,27
AXASA 5.453 PERP	2,20
LLOYDS 6.657 01/29/49	2,09

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.