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 9 aprile 2021
www.anthilia.it

LIPPER L HIGHEST 5 4 3 2 1 LOWEST

AnthiliaWhite

Anthilia White

Gestore	Markus Ratzinger Anne-Sophie Chouillou
AUM comparto (Mln €)	92,0
Valuta di riferimento	Euro €
Frequenza del NAV	Quotidiana
Tipo di OICR	UCITS V SICAV
Domicilio	Lussemburgo
Depositaria	RBC Investor Services
Revisore	EY
Management fee (%) A	1,00
Management fee (%) B	0,65
Management fee (%) C	0,40
Performance fee (%)	20 (High Watermark perpetuo)
Investimento minimo	nessuno classe A € 250.000 classe B € 5.000.000 classe C

Classe C (Istituzionale)

NAV (Valore quota)	**131,01**
Data di lancio	28 gennaio 2008
ISIN code	LU0599024741
Bloomberg ticker	PLANWTD 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 basso

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 (%)
IBRD	11,09
HSBC	9,54
Goldman Sachs	8,64
Mediobanca	8,17
Citibank	5,28
Austria	3,69
Unicredito	3,66
Deutsche Bank	2,28

Rating del portafoglio

Rating	Peso (%)
AAA	1,47
AA	11,96
A	18,15
BBB	5,08
BB	2,43
B	0,88
CCC	0,00

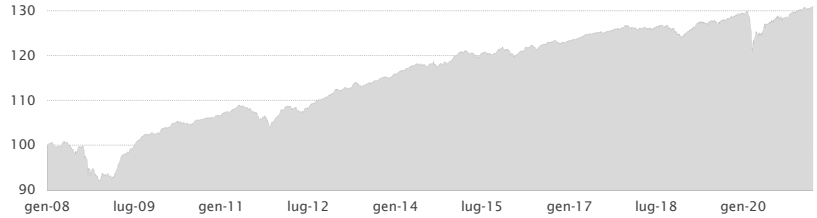
Portafoglio obbligazionario

Duration portafoglio bond	1,12

Esposizione valutaria

Valuta	Peso (%)
EUR	94,20
USD	2,54
GBP	3,26

NAV dal lancio



Rendimenti mensili (%)

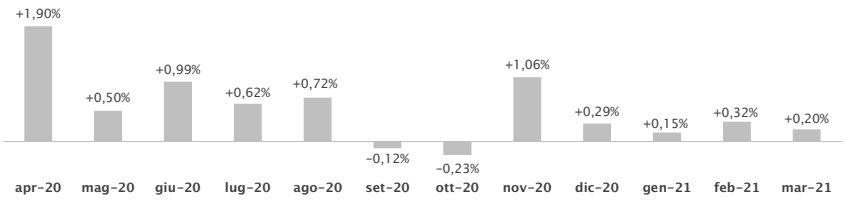
	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Anno
2008	+0,10	+0,46	-1,01	+0,84	+0,12	-1,11	-0,76	+1,05	-2,77	-3,03	-0,57	-0,47	**-7,02**
2009	+0,32	-0,24	+0,73	+3,26	+1,20	+1,00	+1,29	+0,96	+1,21	+0,08	-0,06	+0,12	**+10,28**
2010	+1,13	+0,14	+1,02	+0,29	-0,32	+0,02	-0,02	+0,78	+0,09	+0,30	+0,04	+0,38	**+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	-0,28	-4,78	+1,90	+0,50	+0,99	+0,62	+0,72	-0,12	-0,23	+1,06	+0,29	**+0,64**
2021	+0,15	+0,32	+0,20	+0,22									**+0,89**

Analisi della performance

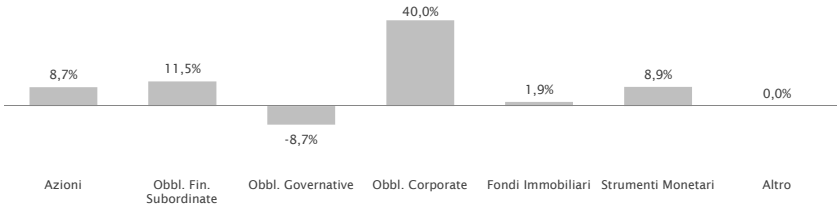
Rendimento da inizio anno	+0,89%	Correlazione col mercato	-0,02
Rendimento dal lancio	+31,01%	Alpha	1,72%
Sharpe ratio	0,83	Beta	-0,02
Volatilità annualizzata	+2,01%	Tempo di recupero (mesi)	8,20
VaR mensile 99%	+2,43%	Massimo drawdown	-8,72%

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

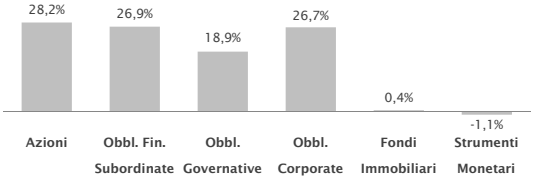
Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio



Contribuzione al rischio di portafoglio



Titoli in portafoglio (primi 10)

Descrizione titolo	(%)
HSBC BANK PLC	9,33
BTPS 0.4 04/11/24	6,72
CITIGROUP INC 2 1/2 09/30/26	5,49
IBRD 0 08/11/26	5,16
IBRD FLOAT 05/31/26	4,02
ITALY 0 06/28/29	3,79
AUST 0 10/10/25	3,41
GS FLOAT 10/29/21	3,09
UCGIM 0 05/31/23	3,06
BACRED 0 11/21/21	2,93

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.