Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Yellow
Fondo Obbligazionario Flessibile

Weekly Report 9 aprile 2021
www.anthilia.it

LIPPER L HIGHEST 5 4 3 2 1 LOWEST

Premio Tripla A MILANO FINANZA

Anthilia Yellow

Classe A (Retail)

NAV (Valore quota)	**151,82**	
Gestore	Markus Ratzinger Anne-Sophie Chouillou	
AUM comparto (Mln €)	51,2	
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

Basso rischio — Alto rischio

1 2 3 4 5 6 7

Rischio medio

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 (%)
AXA	6,15
Deutsche Bank	5,07
Generali	4,99
Unicredito	4,85
Barclays	4,66
Lloyds	4,32
HSBC	4,29

Rating del portafoglio

Rating	Peso (%)
AAA	0,00
AA	-7,11
A	2,97
BBB	17,65
BB	24,96
B	5,54
CCC	3,04
NR	4,69

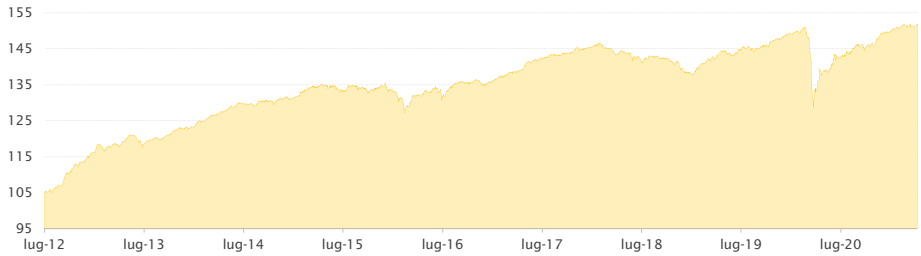
Portafoglio obbligazionario

Duration portafoglio bond	1,97

Esposizione valutaria

Valuta	Peso (%)
EUR	99,01
USD	0,36
GBP	0,62

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	-0,36	+0,17	+2,39	+0,43	**+0,62**
2021	+0,47	+0,70	-0,07	+0,26									**+1,36**

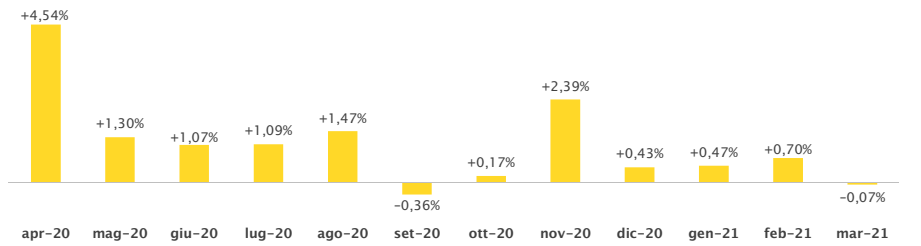
Analisi della performance

Statistiche a 1 anno	
Rendimento da inizio anno	+1,36%
Sharpe ratio	3,14
Alpha	9,27%
Beta	0,15
Volatilità annualizzata	3,47%

Statistiche dal lancio	
Rendimento	+44,78%
VaR mensile 99%	+2,00%
Correlazione col mercato	0,43
Massimo drawdown	-14,77%
Tempo di recupero (mesi)	11,36

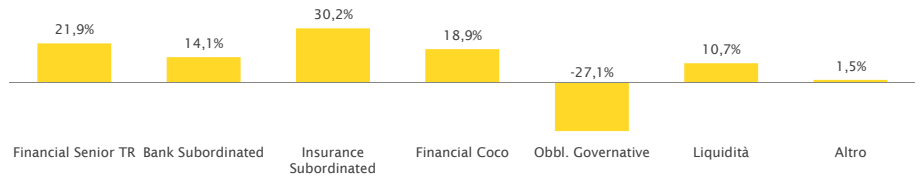
Alpha e Beta sono calcolati in riferimento all'indice Iboxx Euro Financial Subordinated TR

Rendimenti mensili ultimi 12 mesi

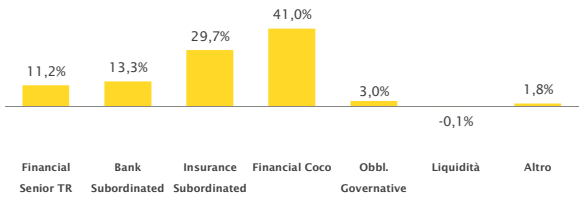


Composizione del portafoglio

Asset allocation



Contribuzione al rischio di portafoglio



Titoli in portafoglio (primi 10)

Descrizione titolo	(%)
AXASA 6.6862 PERP	3,47
ASSGEN 6.269 PERP	3,37
HSBC BANK PLC	3,01
BTPS 0 1/2 04/20/23 IND	3,01
AXASA 5.453 PERP	2,69
UCGIM 0 05/31/23	2,66
ISPIM 5.148 06/10/30	2,60
CITIGROUP INC 2 1/2 09/30/26	2,04
SANTAN 1 PERP	1,82
XLIT LTD	1,81

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.