

# Anthilia Capital Partners SGR

## Anthilia White Planetarium Sicav Fondo Absolute Return

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

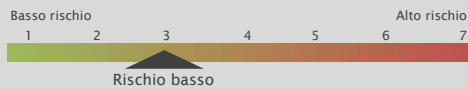
### Anthilia White

|                       |   |          |
|-----------------------|---|----------|
| Gestore               | Markus Ratzinger<br>Anne-Sophie Chouillou |          |
| AUM comparto (Mln €)  | 95,1                                      |          |
| Valuta di riferimento | Euro €                                    |          |
| Frequenza del NAV     | Quotidiana                                |          |
| Tipo di OICR          | UCITS V SICAV                             |          |
| Domicilio             | Lussemburgo                               |          |
| Depositaria           | BNP Paribas Securities 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)    | 132,98                             |
| 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



### 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          | 13,36    |
| HSBC          | 9,48     |
| Citibank      | 6,47     |
| Mediobanca    | 6,41     |
| Goldman Sachs | 6,39     |
| Deutsche Bank | 4,04     |
| Unicredit     | 3,95     |
| Austria       | 3,62     |

### Rating del portafoglio

|        |          |
|--------|----------|
| Rating | Peso (%) |
| AAA    | 0,40     |
| AA     | 11,89    |
| A      | 19,20    |
| BBB    | 5,95     |
| BB     | 2,36     |
| B      | 0,90     |
| CCC    | 0,00     |

### Portafoglio obbligazionario

|                           |      |
|---------------------------|------|
| Duration portafoglio bond | 1,12 |
|---------------------------|------|

### Esposizione valutaria

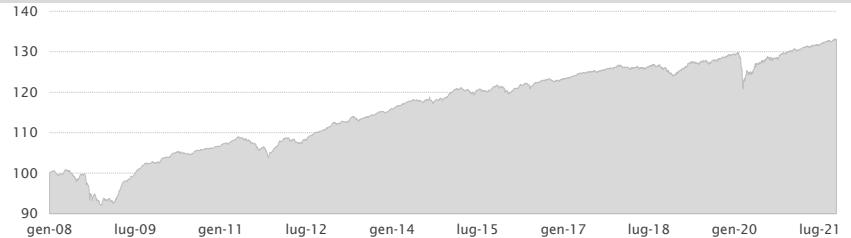
|        |          |
|--------|----------|
| Valuta | Peso (%) |
| EUR    | 94,15    |
| USD    | 1,83     |
| GBP    | 4,03     |

Weekly Report 11 novembre 2021  
www.anthilia.it

LIPPER 1 5 4 3 2 1 0



### NAV dal lancio



### Rendimenti mensili (%)

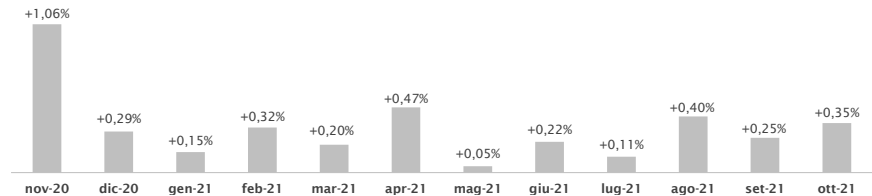
|      | Gen   | Feb   | Mar   | Apr   | Mag   | Giu   | Lug   | Ago   | Set   | Ott   | Nov   | Dic   | Anno   |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 2008 | +0,10 | +0,46 | -1,01 | +0,84 | +0,12 | -1,11 | -0,76 | +1,05 | -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 | +0,47 | +0,05 | +0,22 | +0,11 | +0,40 | +0,25 | +0,35 | -0,14 |       | +2,41  |

### Analisi della performance

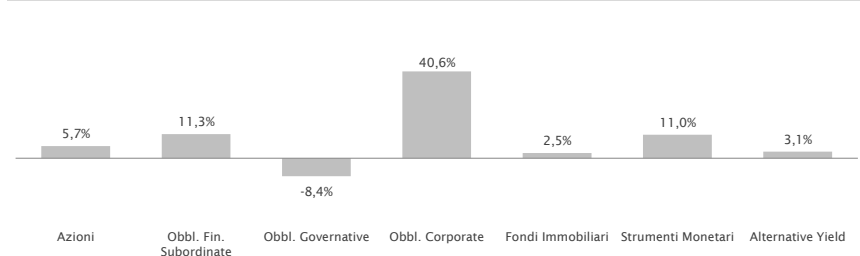
|                           |         |                          |        |
|---------------------------|---------|--------------------------|--------|
| Rendimento da inizio anno | +2,41%  | Correlazione col mercato | -0,03  |
| Rendimento dal lancio     | +32,98% | Alpha                    | 1,78%  |
| Sharpe ratio              | 0,87    | Beta                     | -0,02  |
| Volatilità annualizzata   | +1,98%  | Tempo di recupero (mesi) | 8,20   |
| VaR mensile 99%           | +1,64%  | Massimo drawdown         | -8,72% |

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

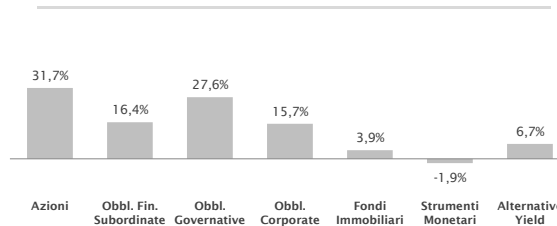
### Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



### Composizione del portafoglio



### Contribuzione al rischio di portafoglio



### Titoli in portafoglio (primi 10)

|                              |      |
|------------------------------|------|
| Descrizione titolo           | (%)  |
| HSBC BANK PLC                | 8,33 |
| CITIGROUP INC 2 1/2 09/30/26 | 6,89 |
| IBRD FLOAT 05/31/26          | 6,70 |
| BTPS 0.4 04/11/24            | 5,55 |
| BACRED 0 11/21/21            | 3,60 |
| AUST 0 10/10/25              | 3,30 |
| UCGIM 0 05/31/23             | 3,10 |
| DB 2 03/09/26                | 2,69 |
| GS 6 07/25/28                | 2,62 |
| IBRD 0 10/07/25              | 2,61 |

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.