

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Blue Planetarium Sicav Fondo Global Macro

Weekly Report 09 dicembre 2022
www.anthilia.it



Anthilia Blue

Gestori	Giuseppe Sersale	
AUM comparto (Mln €)	17,9	
Valuta di riferimento	Euro €	
Frequenza del NAV	Quotidiano	
Tipo di OICR	SICAV UCITS V	
Domicilio	Lussemburgo	
Depositaria	BNP Paribas	
Revisore	EY	
Management fee (%) A	1,45	
Management fee (%) B	0,95	
Performance fee (%)	20 (high watermark perpetuo)	
Investimento minimo	Nessuno	classe A
	€ 250.000	classe B

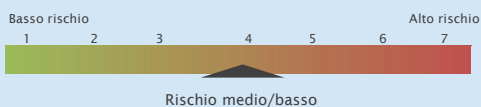
AUM SGR (Mln €) 1069,279213

Classe B (Istituzionale)

NAV (Valore quota)	96,43
Data di lancio	28 novembre 2008
ISIN code	LU0374938057
Bloomberg ticker	PLANTBB 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. Obiettivo del fondo è generare rendimenti positivi diversificando le classi di investimento. Il portafoglio seleziona azioni prevalentemente europee, in base ad un'analisi di tipo fondamentale, e le combina con titoli di stato, obbligazioni corporate, indici azionari e futures sui cambi. Sono esclusi dalla politica d'investimento titoli derivati non quotati. Gli investimenti azionari su singoli titoli si rivolgono prevalentemente a società con elevata capitalizzazione. Gli investimenti obbligazionari sono selezionati fra gli emittenti governativi, sovranazionali o corporate con rating pari almeno a investment grade. L'investimento in covered warrants e in asset backed securities (ABS) è escluso. Il comparto può investire in quote di altri fondi nel limite del 10% del patrimonio. Ai fini di copertura del rischio di cambio, gli investimenti in divise diverse dall'euro potranno essere coperti. Il comparto può ricorrere a strumenti finanziari derivati con finalità di copertura dei rischi, di gestione efficiente del portafoglio e di investimento. Il rischio globale connesso agli strumenti finanziari derivati non può superare il valore del patrimonio netto del comparto. È escluso l'investimento in derivati di credito. Le modalità d'investimento permettono una liquidabilità giornaliera totale del portafoglio.

Esposizione settoriale azionaria

Settore	Peso (%)
Software and Computer Services	2,12
Industrial Support Services	1,67
Banks	1,12

Esposizione geografica azionaria (primi 3)

Paese d'origine	Peso (%)
GERMANY	2,26
UNITED STATES	1,86
ITALY	1,69
FINLAND	0,96

Portafoglio obbligazionario

Duration portafoglio bond	-0,32
---------------------------	-------

Esposizione valutaria

Valuta	Peso (%)
EUR	88,7
CHF	0,1
GBP	-4,4
USD	15,2
JPY	0,3

NAV dal lancio



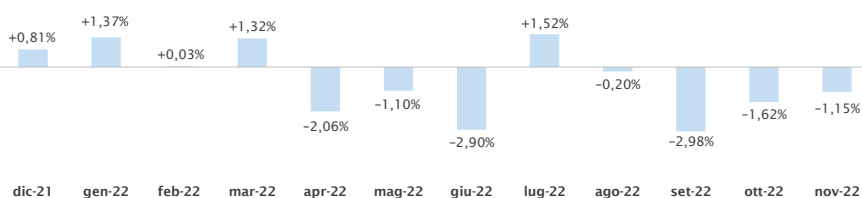
Rendimenti mensili (%)

	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Anno
2008	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-1,01	N.D.
2009	+0,25	+0,25	+0,07	+1,12	+0,06	-0,50	+0,23	+0,68	+0,95	+0,39	+0,01	+0,34	+3,90
2010	-1,15	-0,53	+0,49	+0,84	-0,25	+0,59	-0,77	+1,10	+0,24	+0,19	+0,83	+1,20	+2,79
2011	-1,34	-0,33	+0,14	+0,01	+0,40	-0,98	-0,25	-2,26	-2,43	+2,02	-4,00	+0,51	-8,32
2012	+4,11	+2,56	-0,72	-2,75	-2,33	-0,26	+2,66	+1,81	+2,09	+0,99	+0,32	+1,05	+9,70
2013	+1,56	-2,55	+0,20	+0,43	+0,19	-1,52	+0,84	+0,40	-0,02	+1,33	+1,51	-1,07	+1,23
2014	-0,19	+1,00	+0,20	-0,46	+0,13	+0,00	-0,51	-0,32	+0,16	-1,46	+1,21	+0,75	+0,47
2015	+5,18	+4,18	+1,71	-1,85	-1,13	-3,15	+2,71	-2,75	-3,13	+5,05	+1,50	-2,45	+5,40
2016	-3,60	-1,63	+1,50	+2,01	-0,02	-3,02	+1,87	+1,26	-0,63	+2,86	-1,49	+2,85	+1,69
2017	-0,27	-0,37	+0,14	+0,55	-0,36	-0,56	-0,18	-1,25	+1,48	+0,82	-0,49	-1,14	-1,66
2018	+0,22	-0,06	-2,46	+1,80	-0,43	-0,48	+0,92	-1,77	+1,58	-3,31	-0,01	-3,79	-7,70
2019	+3,93	+1,11	-0,34	+0,96	-1,03	+0,55	+0,06	-0,69	+0,80	+0,74	+0,62	+1,47	+8,40
2020	-1,70	-0,65	-3,96	-1,31	+1,25	+0,87	+1,94	-0,35	-0,46	-0,17	-0,33	+0,80	-4,12
2021	-0,05	+0,06	+1,26	-0,03	+1,81	-0,54	+0,71	+0,18	+1,16	+0,55	-1,20	+0,81	+4,78
2022	+1,37	+0,03	+1,32	-2,06	-1,10	-2,90	+1,52	-0,20	-2,98	-1,62	-1,15	+1,61	-6,13

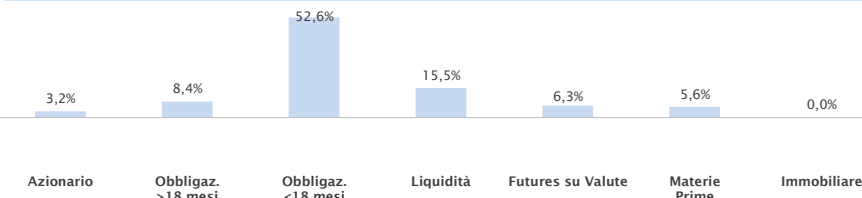
Analisi della performance

Rendimento da inizio anno	-6,13%	Volatilità annualizzata	5,76%
Rendimento dal lancio	+7,53%	VaR mensile 99%	4,71%
Sharpe ratio	0,08	Massimo drawdown	-16,25%
Alpha	-0,45%	Tempo di recupero (mesi)	-
Beta	0,16	Correlazione col mercato	0,58

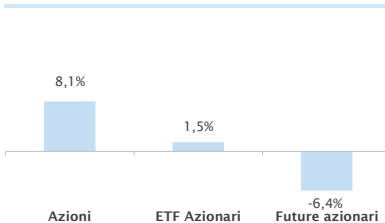
Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio



Composizione azionaria



Dettaglio del portafoglio azionario

Descrizione titolo	(%)
S&P500 EMINI FUT DEC 22	16,78
NASDAQ 100 E-MINI DEC 22	11,08
EURO STOXX TECH DEC 22	3,25
EURO STOXX HEALTH DEC 22	2,21
SAP SE	1,14
DEUTSCHE BANK-RG	1,12
MICROSOFT CORP	0,98
NOKIA OYJ	0,96

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.