

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Blue Planetarium Sicav Fondo Global Macro

Weekly Report 13 gennaio 2023
www.anthilia.it



Anthilia Blue

| | | |
|-----------------------|------------------------------|----------|
| Gestori | Giuseppe Sersale | |
| AUM comparto (Mln €) | 17,5 | |
| 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 |

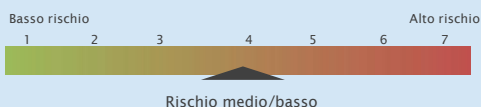
AUM SGR (Mln €) 11.28.061.467

Classe B (Istituzionale)

| | |
|--------------------|------------------|
| NAV (Valore quota) | 94,80 |
| 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 | 2,17 |
| Industrial Support Services | 1,79 |
| Banks | 1,35 |

Esposizione geografica azionaria (primi 3)

| Paese d'origine | Peso (%) |
|-----------------|----------|
| GERMANY | 2,57 |
| UNITED STATES | 1,89 |
| ITALY | 1,84 |
| FINLAND | 0,98 |

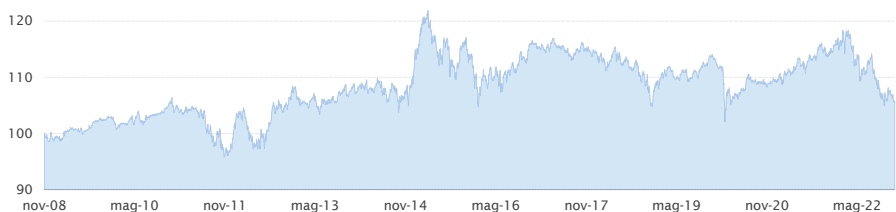
Portafoglio obbligazionario

| | |
|---------------------------|-------|
| Duration portafoglio bond | -0,82 |
|---------------------------|-------|

Esposizione valutaria

| Valuta | Peso (%) |
|--------|----------|
| EUR | 90,4 |
| CHF | 0,1 |
| GBP | -4,4 |
| USD | 13,6 |
| JPY | 0,3 |

NAV dal lancio



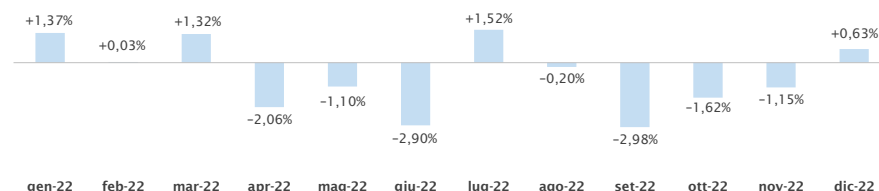
Rendimenti mensili (%)

| | 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 | +0,63 | -7,04 |
| 2023 | -0,73 | | | | | | | | | | | | -0,73 |

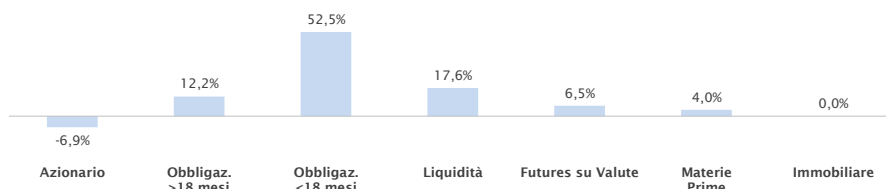
Analisi della performance

| | | | |
|---------------------------|--------|--------------------------|---------|
| Rendimento da inizio anno | -0,73% | Volatilità annualizzata | 5,75% |
| Rendimento dal lancio | +5,71% | VaR mensile 99% | 3,70% |
| Sharpe ratio | 0,06 | Massimo drawdown | -16,25% |
| Alpha | -0,62% | Tempo di recupero (mesi) | - |
| Beta | 0,16 | Correlazione col mercato | 0,58 |

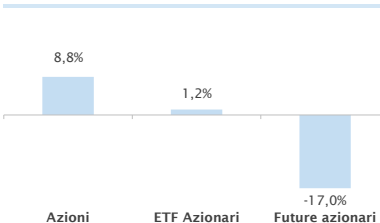
Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio



Composizione azionaria



Dettaglio del portafoglio azionario

| Descrizione titolo | (%) |
|---------------------|------|
| DEUTSCHE BANK-RG | 1,35 |
| DBX CSI 300 | 1,24 |
| SAP SE | 1,22 |
| ENI SPA | 0,99 |
| NOKIA OYJ | 0,98 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 0,95 |
| MICROSOFT CORP | 0,94 |
| NEXI SPA | 0,85 |

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.