

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Red Planetarium Sicav Fondo Long Bias Euro Equity

Weekly Report
www.anthilia.it

17 febbraio 2023



Anthilia Red

| | |
|-----------------------|--|
| Gestore | Paolo Rizzo |
| AUM comparto (Mln €) | 29,4 |
| Valuta di riferimento | Euro € |
| Frequenza del NAV | Giornaliera |
| Tipo di OICR | SICAV UCITS V |
| Domicilio | Lussemburgo |
| Depositaria | BNP Paribas |
| Revisore | EY |
| Management fee (%) A | 1,75 |
| Management fee (%) B | 1,05 |
| Performance fee (%) | 20 (high watermark perpetuo) |
| Investimento minimo | Nessuno classe A € 250.000 classe B |

Classe B (Istituzionale)

| | |
|--------------------|--------------|
| NAV (Valore quota) | 162,21 |
| Data di lancio | 18/08/2008 |
| ISIN Code | LU0374939022 |
| Bloomberg ticker | PLAREDB 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 di investimento

Stile di gestione flessibile, tecnica di selezione degli strumenti finanziari di tipo fondamentale. Il portafoglio è investito in azioni area euro, obbligazioni convertibili, titoli di stato area euro e corporate, tutti negoziati in mercati regolamentati. L'investimento in titoli di emittenti a media e bassa capitalizzazione (inferiore a 1 miliardo di euro) non supera il 50% del patrimonio netto del comparto. L'investimento in covered warrants e in asset backed securities (ABS) è escluso. Il comparto può investire in quote di altri fondi di investimento nel limite del 10% del proprio patrimonio. Il comparto può ricorrere a strumenti finanziari derivati con finalità di copertura dei rischi, di efficiente gestione del portafoglio e di investimento. È escluso l'investimento in derivati di credito. Paolo Rizzo, gestore di Anthilia Red, ha una lunga esperienza nell'analisi fondamentale e opera sul mercato mediante frequenti incontri con il management delle Società in cui investe. Ha un approccio di tipo fondamentale, detiene posizioni lunghe di mercato e copre i rischi mediante futures azionari. Le modalità d'investimento permettono una liquidabilità giornaliera totale degli assets in portafoglio.

Esposizione settoriale azionaria

| | |
|---------------------|----------|
| Settore | Peso (%) |
| Personal Goods | 13,45 |
| Banks | 7,87 |
| Chemicals | 6,69 |
| General Industrials | 4,57 |
| Electricity | 2,88 |

Esposizione geografica azionaria (primi 5)

| | |
|-----------------|----------|
| Paese d'origine | Peso (%) |
| FRANCE | 28,79 |
| ITALY | 22,52 |
| GERMANY | 18,06 |
| NETHERLANDS | 9,14 |
| SPAIN | 4,61 |

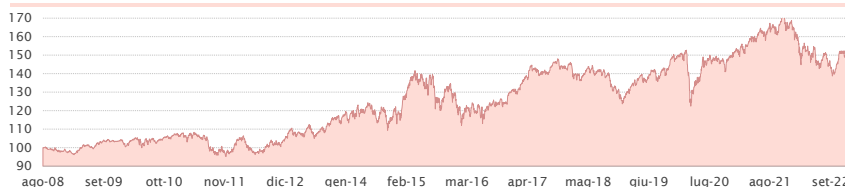
Portafoglio obbligazionario

| | |
|---------------------------|------|
| Duration portafoglio bond | 0,12 |
| Rating minimo | AAA |

Esposizione valutaria

| | |
|--------|----------|
| Valuta | Peso (%) |
| EUR | 97,5 |
| CHF | 1,70 |
| USD | 0,79 |
| GBP | 0,01 |

NAV dal lancio



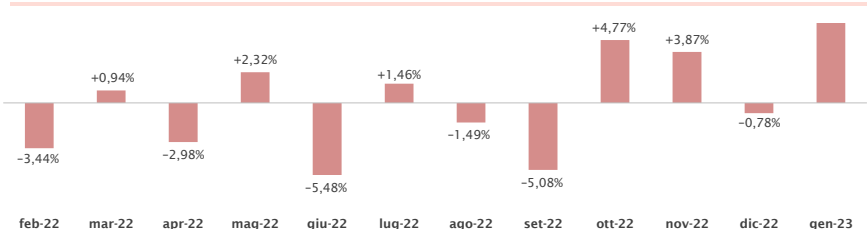
Rendimenti mensili

| | Gen | Feb | Mar | Apr | Mag | Giu | Lug | Ago | Set | Ott | Nov | Dic | Anno |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 2008 | - | - | - | - | - | - | - | +0,13 | -0,88 | -0,37 | -0,23 | -0,43 | N.D. |
| 2009 | -0,41 | -0,92 | +0,34 | +3,09 | +0,86 | -0,69 | +1,35 | +1,42 | +0,28 | -0,02 | -0,18 | +0,33 | +5,53 |
| 2010 | -1,94 | -0,50 | +3,25 | +0,14 | -2,37 | +0,43 | +1,77 | -1,72 | +1,87 | +1,14 | -0,90 | +2,10 | +3,14 |
| 2011 | -0,58 | -0,09 | +0,78 | +1,02 | -1,64 | -0,66 | -1,26 | -4,93 | -1,75 | +3,20 | -3,79 | +1,02 | -8,59 |
| 2012 | +3,57 | +3,19 | -1,69 | -2,35 | -3,24 | +0,21 | +1,85 | +1,15 | +1,61 | +0,23 | +1,62 | +1,36 | +7,50 |
| 2013 | +4,23 | -2,86 | +0,51 | +1,89 | +1,85 | -3,95 | +2,16 | -0,08 | +3,37 | +2,84 | +1,58 | +0,21 | +12,04 |
| 2014 | -2,14 | +3,62 | +1,24 | +0,07 | +0,69 | -0,79 | -1,77 | -0,44 | +0,69 | -4,18 | +5,96 | -2,28 | +0,27 |
| 2015 | +7,15 | +5,23 | +4,05 | -2,21 | +2,69 | -4,34 | +2,65 | -6,83 | -5,52 | +8,99 | +2,21 | -3,67 | +9,28 |
| 2016 | -6,75 | -1,62 | +2,72 | +1,68 | -0,16 | -5,35 | +4,09 | +2,04 | -0,74 | +2,31 | -1,51 | +4,56 | +9,80 |
| 2017 | +0,53 | +0,77 | +4,97 | +2,73 | +0,40 | -2,11 | +0,89 | -0,58 | +3,94 | +1,44 | -2,23 | -1,09 | +9,58 |
| 2018 | +1,26 | -3,03 | -2,27 | +2,97 | +0,29 | -1,47 | +1,93 | -0,20 | -0,69 | -6,97 | -0,05 | -4,26 | -12,18 |
| 2019 | +4,05 | +2,55 | +0,44 | +3,72 | -2,53 | +2,71 | +0,72 | -1,14 | +2,84 | +1,21 | +4,16 | -0,83 | +19,13 |
| 2020 | -0,48 | -4,36 | -7,84 | +5,60 | +4,11 | +0,77 | +0,55 | +1,65 | -1,17 | -3,30 | +5,68 | +1,73 | +2,05 |
| 2021 | -0,87 | +0,88 | +3,42 | +1,39 | +1,15 | +0,98 | +0,10 | +1,14 | -1,84 | +3,82 | -2,08 | +1,90 | +10,25 |
| 2022 | -4,66 | -3,44 | +0,94 | -2,98 | +2,32 | -5,48 | +1,46 | -1,49 | -5,08 | +4,77 | +3,87 | -0,78 | -10,68 |
| 2023 | +6,12 | +2,06 | | | | | | | | | | | +8,30 |

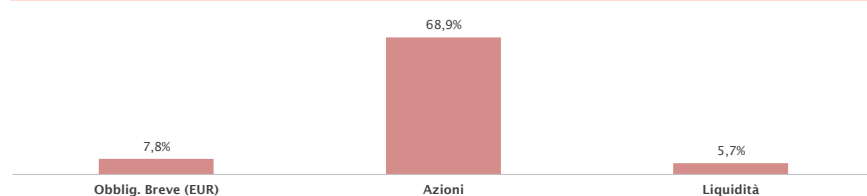
Analisi della performance

| | | | |
|---------------------------|---------|--------------------------|---------|
| Rendimento da inizio anno | +8,30% | Volatilità annualizzata | 10,75% |
| Rendimento dal lancio | +62,21% | VaR mensile 99% | 9,05% |
| Indice di Sharpe | 0,29 | Massimo drawdown | -20,84% |
| Alpha | 1,48% | Tempo di recupero (mesi) | 24,14 |
| Beta | 0,39 | Correlazione col mercato | 0,81 |

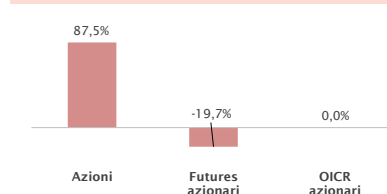
Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio



Composizione azionaria



Dettaglio del portafoglio azionario

| | |
|--------------------------------|----------|
| Descrizione | Peso (%) |
| ASML HOLDING NV | 6,01 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITT | 5,57 |
| SAES GETTERS SPA | 4,86 |
| TOTAL SA | 4,06 |
| SAP SE | 2,82 |
| L'OREAL | 2,65 |
| LINDE PLC | 2,59 |
| SANOFI | 2,53 |
| SIEMENS AG-REG | 2,49 |
| ALLIANZ AG-REG | 2,47 |

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.