

# Anthilia Capital Partners SGR

## Anthilia Yellow

### Fondo Obbligazionario Flessibile

Weekly Report 14 aprile 2023  
www.anthilia.it



LIPPER L 5 4 3 2 1

### NAV dal lancio



### Rendimenti mensili (%)

|      | Gen   | Feb   | Mar    | Apr   | Mag   | Giù   | 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  | +0,65 | +0,09 | +0,38 | -0,20 | +0,34 | +0,28 | -0,37 | -1,27 | +1,12 | +2,11  |
| 2022 | -0,97 | -1,74 | +0,00  | -0,74 | -0,51 | -2,62 | -0,36 | +0,76 | -2,90 | +0,09 | +1,77 | +1,71 | -5,49  |
| 2023 | +1,91 | -0,36 | -4,68  | +0,96 |       |       |       |       |       |       |       |       | -2,28  |

### Analisi della performance

#### Statistiche a 1 anno

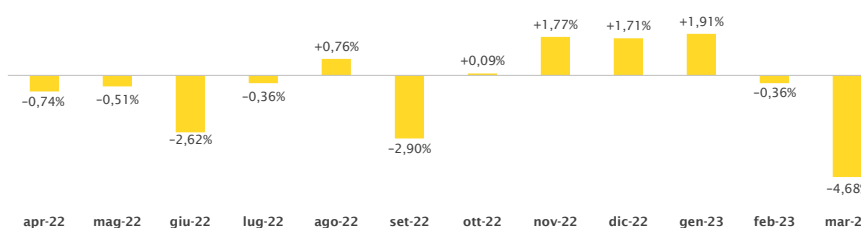
|                           |        |
|---------------------------|--------|
| Rendimento da inizio anno | -2,28% |
| Sharpe ratio              | -1,03  |
| Alpha                     | -3,72% |
| Beta                      | 0,26   |
| Volatilità annualizzata   | 5,52%  |

#### Statistiche dal lancio

|                          |         |
|--------------------------|---------|
| Rendimento               | +34,69% |
| VaR mensile 99%          | +3,77%  |
| Correlazione col mercato | 0,41    |
| Massimo drawdown         | -14,77% |
| Tempo di recupero (mesi) | 11,36   |

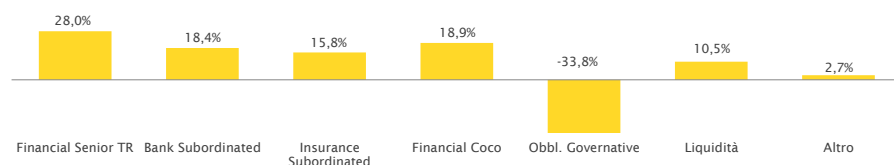
Alpha e Beta sono calcolati in riferimento all'indice Iboxx Euro Financial Subordinated TR

### Rendimenti mensili ultimi 12 mesi

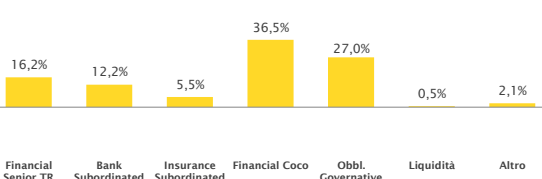


### Composizione del portafoglio

#### Asset allocation



#### Contribuzione al rischio di portafoglio



#### Titoli in portafoglio (primi 10)

| Descrizione titolo            | (%)  |
|-------------------------------|------|
| DB 2.8 04/15/25               | 5,29 |
| BTPS ITALIA 0 05/26/25        | 3,56 |
| CITIGROUP INC 2 1/2 09/30/26  | 3,43 |
| GS 6 1/4 07/11/27             | 3,00 |
| ASSGEN 4.596 11/30/49         | 2,99 |
| CS 7 3/4 03/01/29             | 2,55 |
| HSBC BANK PLC                 | 2,30 |
| ISPM 5.148 06/10/30           | 2,20 |
| UCGIM 5.459 06/30/35          | 2,20 |
| COMMERZBANK 8.625% 28.02.2033 | 2,11 |

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.

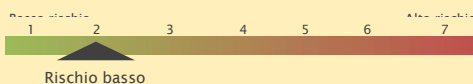
#### Classe A (Retail)

|                       |   |
|-----------------------|---|
| NAV (Valore quota)    | 141,24                                    |
| Gestore               | Markus Ratzinger<br>Anne-Sophie Chouillou |
| AUM comparto (Mln €)  | 43,9                                      |
| Data di lancio        | 2 luglio 2012                             |
| Valuta di riferimento | Euro €                                    |
| Frequenza del NAV     | Giornaliera                               |
| Tipo di OICR          | SICAV UCITS V (armonizzata)               |
| Domicilio             | Lussemburgo                               |
| Depositaria           | BNP Paribas                               |
| Revisore              | EY  |
| ISIN code             | LU1377525735                              |
| Bloomberg ticker      | PLAYELA LX                                |
| Management fee (%)    | 1,25                                      |
| Performance fee (%)   | nessuno                                   |
| Investimento minimo   | € 250.000                                 |
|                       | Classe A                                  |
|                       | 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



#### 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 (%) |
|---------------|----------|
| Deutsche Bank | 6,44     |
| Citibank      | 4,50     |
| Goldman Sachs | 3,79     |
| HSBC          | 3,28     |
| Credit Suisse | 3,19     |
| Banca Intesa  | 2,99     |
| Generali      | 2,85     |

#### Rating del portafoglio

| Rating | Peso (%) |
|--------|----------|
| AAA    | -1,56    |
| AA     | -11,45   |
| A      | 13,12    |
| BBB    | 4,15     |
| BB     | 36,29    |
| B      | 4,46     |
| C      | 0,07     |
| NR     | 2,39     |

#### Portafoglio obbligazionario

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

#### Esposizione valutaria

| Valuta | Peso (%) |
|--------|----------|
| EUR    | 100,87   |
| USD    | -0,73    |
| GBP    | -0,13    |