

# Anthilia Capital Partners SGR

## Anthilia Yellow

### Fondo Obbligazionario Flessibile

Weekly Report 26 maggio 2023  
www.anthilia.it



LIPPER L 5 4 3 2 1

### NAV dal lancio



### Rendimenti mensili (%)

	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	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	+1,39	+0,51								-1,36

### Analisi della performance

#### Statistiche a 1 anno

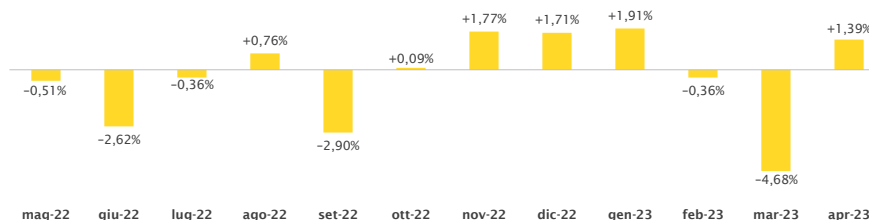
Rendimento da inizio anno	-1,36%
Sharpe ratio	-0,64
Alpha	-2,28%
Beta	0,25
Volatilità annualizzata	5,43%

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

#### Statistiche dal lancio

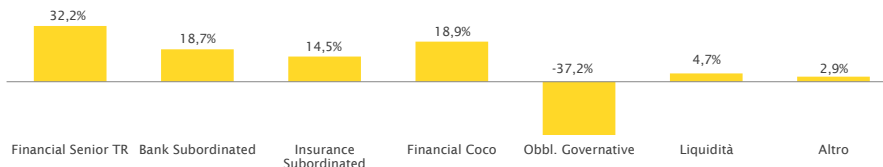
Rendimento	+35,96%
VaR mensile 99%	+3,53%
Correlazione col mercato	0,41
Massimo drawdown	-14,77%
Tempo di recupero (mesi)	11,36

### Rendimenti mensili ultimi 12 mesi

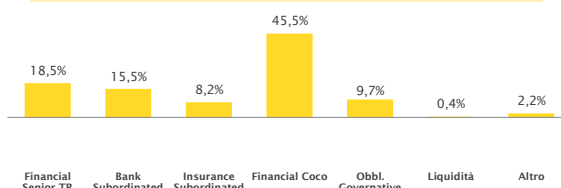


### Composizione del portafoglio

#### Asset allocation



#### Contribuzione al rischio di portafoglio



#### Titoli in portafoglio (primi 10)

Descrizione titolo	(%)
DB 2.8 04/15/25	5,96
CITIGROUP INC 2 1/2 09/30/26	3,85
BTPS ITALIA 0 05/26/25	3,72
CS 6 1/4 07/11/27	3,31
CS 7 3/4 03/01/29	2,83
UCGIM 5.459 06/30/35	2,45
ISPM 5.148 06/10/30	2,40
COMMERZBANK 8.625% 28.02.2033	2,29
BAMIIM 3 3/8 01/19/32	2,20
BARCLAYS PLC	2,13

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)

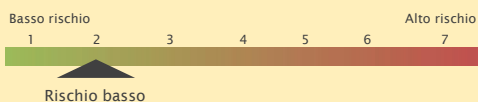
NAV (Valore quota) 142,57

Gestore	Markus Ratzinger
AUM comparto (Mln €)	Anne-Sophie Chouillou
Data di lancio	40,1
Valuta di riferimento	2 luglio 2012
Frequenza del NAV	Euro €
Tipo di OICR	Giornaliera
Domicilio	SICAV UCITS V (armonizzata)
Depositaria	Lussemburgo
Revisore	BNP Paribas
ISIN code	EY
Bloomberg ticker	LU1377525735
Management fee (%)	PLAYELA LX
Performance fee (%)	1,25
Investimento minimo	0,70
	20 (High Watermark perpetuo)
	nessuno
	€ 250.000
	Classe A
	Classe B
	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	6,43
Citibank	4,49
Goldman Sachs	3,87
HSBC	3,49
Credit Suisse	3,22
Banca Intesa	3,01
Generali	2,85

#### Rating del portafoglio

Rating	Peso (%)
AA	0,00
A	14,62
BBB	3,55
BB	37,54
B	4,85
C	0,08
NR	-11,49

#### Portafoglio obbligazionario

Duration portafoglio bond 0,90

#### Esposizione valutaria

Valuta	Peso (%)
EUR	101,40
USD	-0,24
GBP	-1,16