

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Yellow

Classe A
Fondo Obbligazionario Flessibile finanziario

LIPPER 1 2 3 4 5



Info fondo

Gestore	Markus Ratzinger Anne-Sophie Choullou
AUM comparto (Mln €)	41,30 €
Valuta di riferimento	Euro €
Frequenza NAV	Giornaliera
Tipo di OICR	SICAV UCITS V
Domicilio	Luxembourg
Depositaria	BNP Paribas
Revisore	Ernst&Young
Performance fee (%)	20

Il fondo ha cambiato nome e politica di investimento a partire dal 2 luglio 2012 – in precedenza era Profilo Elite Flessibile

Info classe

NAV (Valore quota)	143,62
Data di lancio	2012-07-02
ISIN Code	LU1377525735
Bloomberg ticker	PLAYELA LX
Management fee (%)	none
Minimum investment	none
Contatti	marketing@anthilia.it
Website	www.anthilia.it
Swiss Representative	ACOLIN Fund Services AG
Swiss Paying Agent	PKB Privatbank AG
Publications	www.fundinfo.com

Politica di investimento

Il Fondo mira a conseguire una crescita graduale e costante degli investimenti con un orizzonte temporale di almeno 3 anni. Il focus principale riguarda le obbligazioni societarie europee con particolare riferimento agli emittenti finanziari: banche e assicurazioni. Il Fondo mira a conseguire valore su ciascun emittente selezionando le emissioni che massimizzano il rapporto tra rendimento atteso e volatilità derivante dal profilo di rischio dell'emittente. I rischi di cambio e di duration possono essere coperti (totalmente o parzialmente) a seconda delle condizioni di mercato. Il fondo combina in una soluzione flessibile strumenti obbligazionari senior e subordinati.

Esposizione obbligazionaria per emittente

Emittente	Peso
DEUTSCHE BANK AG – FIL REGNO UNITO	7,10%
INTESA SANPAOLO SPA	4,93%
CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS ...	4,88%
GOLDMAN SACHS FINANCE CORP INTERN...	4,17%
REPUBBLICA ITALIANA	3,62%
COMMERZBANK AG	3,11%
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,81%

Esposizione per rating

Rating	Peso
A+	1,83%
A	5,33%
A-	7,10%
BBB+	4,77%
BBB	7,21%
BBB-	16,15%
BB+	16,28%
BB	17,49%
BB-	7,41%
B+	0,95%

Portafoglio obbligazionario

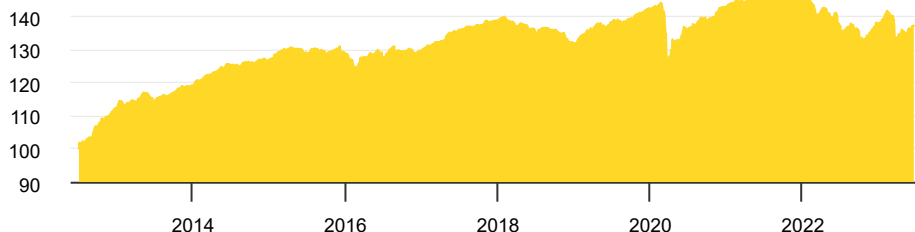
Duration portafoglio bond	0,57
---------------------------	------

Esposizione valutaria

Valuta	Peso
EUR	101,20%
CHF	0,01%
JPY	0,00%

Report al
16 giugno 2023

NAV dal lancio



Rendimenti mensili - ultimi 10 anni

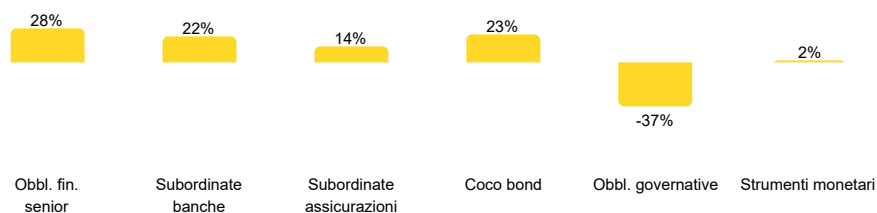
Anno	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Tot
2013	0,69	0,43	0,26	2,14	0,03	-1,68	1,05	0,27	0,73	1,39	0,34	0,21	5,97
2014	1,22	1,14	0,44	1,03	0,81	0,43	0,05	0,49	-0,02	0,23	0,52	0,02	6,54
2015	1,19	0,92	0,27	0,22	-0,12	-1,19	1,23	-0,31	-1,21	0,98	0,51	-1,16	1,29
2016	-1,41	-1,53	2,18	1,12	0,46	-1,72	2,06	-0,45	0,08	0,63	-1,17	0,70	0,87
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	-0,58	-4,89
2019	1,56	1,10	0,27	1,35	-0,89	1,24	0,44	-0,35	0,60	0,94	0,64	0,55	7,67
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	0,00	0,40	-2,90	0,09	1,77	1,71	-5,49
2023	1,91	-0,36	-4,68	1,39	0,57	0,67	-	-	-	-	-	-	-0,64

Analisi delle performance

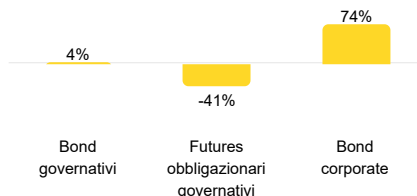
Rendimento da inizio anno	-0,64%	Volatilità annualizzata	3,59%
Rendimento dal lancio	36,96%	Massimo drawdown	-14,77%
Indice di Sharpe	0,84	Tempo di recupero (mesi)	10,60
Alpha	1,07%	Correlazione col mercato	0,43
Beta	0,43		

* statistiche di confronto calcolate in riferimento all'indice iBoxx Euro Financial Subordinated Total Return Index

Composizione del portafoglio



Composizione obbligazionaria



Top holdings

Descrizione	Peso
DEUTSCHE BK LOND 15-15/04/2025 FRN FLAT	5,62%
CITIGROUP GLOBAL 16-30/09/2026 FRN	3,62%
ITALY BTPS 1.4% 20-26/05/2025	3,62%
ANTHILIA BIT III A1	3,15%
GS FIN C INTL 17-11/07/2027 FRN	3,12%
UBS GROUP AG	2,74%
UNICREDIT SPA 20-30/06/2035 FRN	2,43%
INTESA SANPAOLO 5.148% 20-10/06/2030	2,29%
COMMERZBANK AG 22-28/02/2033 FRN	2,25%
BANCO BPM SPA 3.375% 22-19/01/2032	2,14%

Questo documento non costituisce sollecitazione e non rappresenta un'offerta formale all'acquisto o alla sottoscrizione di strumenti finanziari. Qualsiasi ricerca o analisi presente in questo documento è basata su fonti ritenute affidabili, ma non vi è garanzia sull'accuratezza e completezza di tali fonti. Ogni opinione, stima o previsione può essere modificata in qualsiasi momento senza preavviso. Questo documento non è destinato alla distribuzione a investitori retail e non è diretto a persone fisiche o giuridiche che siano cittadini o residenti o aventi sede in luoghi, regioni, paesi o altre giurisdizioni dove tale distribuzione, pubblicazione, disponibilità o uso siano contrari a leggi o regolamentazioni. I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. Questo documento è prodotto da Anthilia Capital Partners SGR Spa per uso interno e non può essere riprodotto o distribuito, sia parzialmente che integralmente, senza autorizzazione da parte di Anthilia Capital Partners SGR Spa.