

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Yellow

Classe A
Fondo Obbligazionario Flessibile finanziario

LIPPER



AnthiliaYellow

Info fondo

| | |
|-----------------------|----------------------|
| Gestore | Anne-Sophie Choullou |
| AUM comparto (Mln €) | 44,38 € |
| 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) | 153,75 |
| Data di lancio | 2012-07-02 |
| ISIN Code | LU1377525735 |
| Bloomberg ticker | PLAYELA LX |
| Management fee (%) | 1.25 |
| 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 |
|---------------------------------------|-------|
| INTESA SANPAOLO SPA | 7,27% |
| DEUTSCHE BANK AG - FIL REGNO UNITO | 6,01% |
| CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS ... | 4,55% |
| GOLDMAN SACHS FINANCE CORP INTERN... | 4,37% |
| COMMERZBANK AG | 3,27% |
| REPUBBLICA ITALIANA | 3,23% |
| BANCO BPM SOCIETA PER AZIONI | 2,86% |

Esposizione per rating

| Rating | Peso |
|--------|--------|
| A | 5,04% |
| A- | 6,01% |
| BBB+ | 3,26% |
| BBB | 2,79% |
| BBB- | 10,07% |
| BB+ | 10,67% |
| BB | 12,35% |
| BB- | 6,12% |

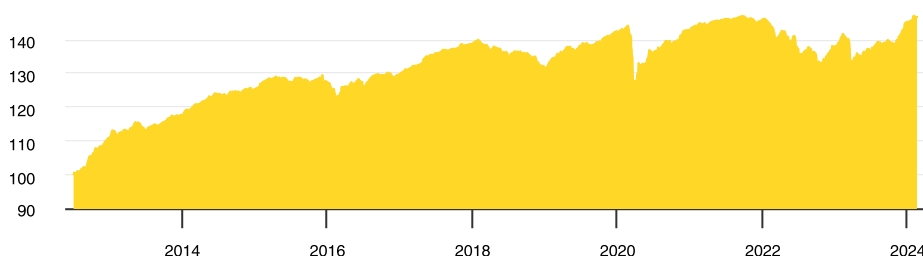
Duration portafoglio bond 1.51

Esposizione valutaria

| Valuta | Peso |
|--------|--------|
| EUR | 97,89% |
| USD | 1,60% |
| GBP | 1,07% |
| CHF | 0,01% |
| JPY | 0,00% |

Report al
16 febbraio 2024

NAV dal lancio



Rendimenti mensili - ultimi 10 anni

| Anno | Gen | Feb | Mar | Apr | Mag | Giu | Lug | Ago | Set | Ott | Nov | Dic | Tot |
|------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2014 | 1,25 | 1,30 | 0,35 | 0,95 | 0,84 | 0,54 | 0,03 | 0,49 | -0,17 | 0,37 | 0,52 | -0,02 | 6,64 |
| 2015 | 1,26 | 0,69 | 0,37 | 0,42 | -0,15 | -0,96 | 0,81 | -0,54 | -0,73 | 0,93 | 0,42 | -0,80 | 1,71 |
| 2016 | -1,56 | -1,93 | 2,40 | 0,88 | 0,51 | -1,79 | 2,02 | 1,02 | 0,08 | 0,63 | -1,17 | 0,70 | 1,69 |
| 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 | 0,57 | 0,52 | 1,66 | -0,22 | 0,23 | -0,32 | 2,11 | 2,53 | 5,28 |
| 2024 | 1,23 | -0,19 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 1,04 |

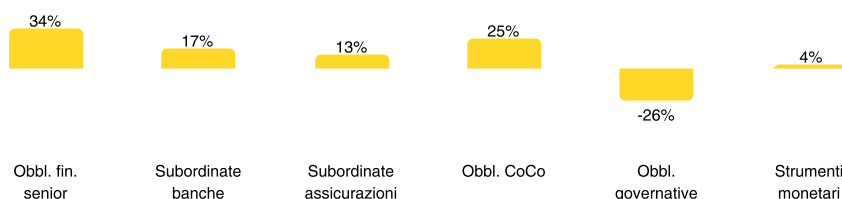
Analisi delle performance

| | | | |
|---------------------------|--------|---------------------------|---------|
| Rendimento da inizio anno | 1,04% | Volatilità annualizzata | 3,46% |
| Rendimento dal lancio | 46,62% | Massimo drawdown | -14,77% |
| Indice di Sharpe | 0,92 | Tempo di recupero (mesi) | 10,60 |
| Alpha* | 1,11% | Correlazione col mercato* | 0,52 |
| Beta* | 0,51 | ESG score** | 77/100 |

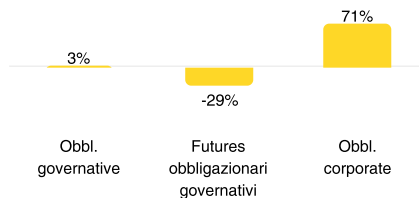
* statistiche di confronto calcolate in riferimento all'indice iBoxx Euro Financial Subordinated Total Return Index

** Lo score ESG sintetizza aspetti ambientali, sociali e di governance attraverso un valore da 0 (minimo) a 100 (massimo)

Composizione del portafoglio



Composizione obbligazionaria



Top holdings

| Descrizione | Peso |
|---|-------|
| DEUTSCHE BK LOND 15-15/04/2025 FRN FLAT | 4,60% |
| INTESA SANPAOLO 22-21/11/2033 FRN | 3,46% |
| CITIGROUP GLOBAL 16-30/09/2026 FRN | 3,40% |
| GS FIN C INTL 17-11/07/2027 FRN | 3,39% |
| Cash at sight DE - BP2S LUXEMBOURG | 3,32% |
| ITALY BTPS 1.6% 22-28/06/2030 | 3,23% |
| ANTHILIA BIT III A1 | 2,83% |
| INTESA SANPAOLO 6.625% 23-31/05/2033 | 2,76% |
| UNICREDIT SPA 20-30/06/2035 FRN | 2,44% |
| COMMERZBANK AG 22-28/02/2033 FRN | 2,39% |

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.