

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia White

Classe C
Fondo Absolute Return

Report al
5 aprile 2024

LIPPER



Info fondo

| | |
|-----------------------|------------------|
| Gestore | Markus Ratzinger |
| AUM comparto (Mln €) | 79,02 € |
| Valuta di riferimento | Euro € |
| Frequenza NAV | Giornaliera |
| Tipo di OICR | SICAV UCITS V |
| Domicilio | Luxembourg |
| Depositaria | BNP Paribas |
| Revisore | Ernst&Young |
| Performance fee (%) | 20 |

Info classe

| | |
|----------------------|-------------------------|
| NAV (Valore quota) | 139,21 |
| Data di lancio | 2008-01-28 |
| ISIN Code | LU0599024741 |
| Bloomberg ticker | PLANWTD LX |
| Management fee (%) | 0.4 |
| Minimum investment | 5000000 |
| 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

Stile di gestione flessibile a ritorno assoluto, con volatilità massima del 3%. Il Fondo riguarda un rendimento stabile positivo attraverso un asset allocation basata sulla massima diversificazione. Il portafoglio è costruito selezionando titoli che offrono un premio al rischio interessante sulla base dello scostamento tra prezzo di mercato e "fair value" nelle diverse asset class oggetto di investimento. Volatilità e liquidabilità sono due parametri / requisiti importanti nella selezione delle opportunità. Il fondo può investire in obbligazioni corporate e governative, strutturate, convertibili, ABS, azioni e certificati. L'utilizzo di OICR è possibile fino a un massimo del 10% del patrimonio. E' ammesso l'uso di derivati a scopo di copertura dei fattori di rischio giudicati non interessanti.

Esposizione obbligazionaria per emittente

| Emittente | Peso |
|---------------------------------------|--------|
| IBRD-INTERNATIONAL BANK FOR RECON... | 13,88% |
| REPUBBLICA ITALIANA | 10,37% |
| CITIGROUP GLOBAL MARKETS HOLDINGS ... | 9,26% |
| DEUTSCHE BANK AG - FIL REGNO UNITO | 9,13% |
| GOLDMAN SACHS FINANCE CORP INTERN... | 8,43% |
| HSBC BANK PLC | 5,56% |
| REPUBBLICA AUSTRIACA | 3,28% |
| INTESA SANPAOLO SPA | 2,11% |
| EBRD-EUROPEAN BANK FOR RECONSTRU... | 2,08% |
| GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL | 1,02% |

Esposizione per rating

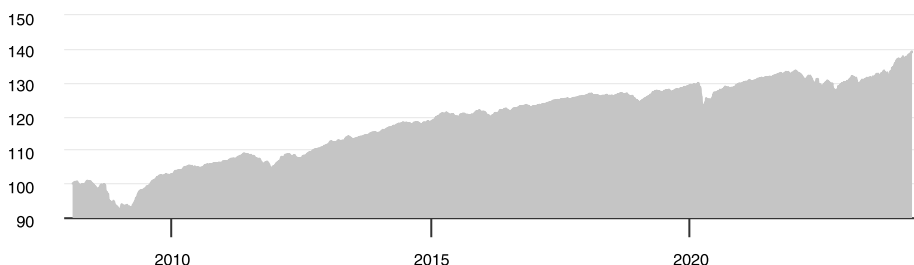
| Rating | Peso |
|--------|--------|
| AAA | 16,17% |
| AA+ | 3,28% |
| A+ | 7,25% |
| A | 18,74% |
| A- | 0,19% |
| BBB+ | 0,84% |
| BBB | 9,83% |
| BBB- | 7,56% |

Duration portafoglio bond 2

Esposizione valutaria

| Valuta | Peso |
|--------|--------|
| EUR | 88,29% |
| USD | 5,97% |
| GBP | 5,03% |
| SEK | 0,82% |
| ITL | 0,15% |
| CHF | 0,03% |

NAV dal lancio



Rendimenti mensili - ultimi 10 anni

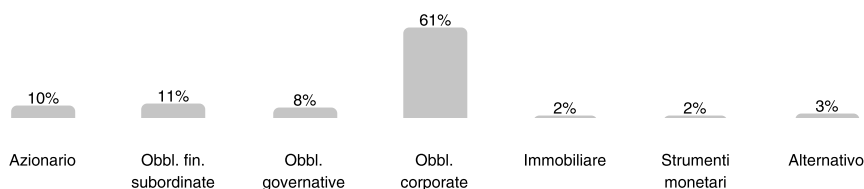
| Anno | Gen | Feb | Mar | Apr | Mag | Giu | Lug | Ago | Set | Ott | Nov | Dic | Tot |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2014 | 0,56 | 0,54 | 0,44 | 0,45 | 0,35 | -0,02 | 0,05 | 0,11 | -0,03 | -0,08 | 0,31 | 0,23 | 2,96 |
| 2015 | 0,83 | 0,73 | 0,17 | -0,07 | 0,02 | -0,87 | 0,83 | -0,04 | -0,32 | 0,73 | 0,60 | -0,28 | 2,32 |
| 2016 | -0,81 | -0,32 | 0,78 | 0,71 | 0,32 | -0,87 | 0,93 | 0,25 | 0,35 | 0,28 | -0,58 | 0,06 | 1,11 |
| 2017 | 0,55 | 0,06 | 0,38 | 0,47 | 0,21 | 0,14 | 0,09 | -0,09 | 0,39 | 0,24 | 0,25 | 0,07 | 2,80 |
| 2018 | 0,30 | -0,24 | -0,44 | 0,30 | -0,21 | -0,03 | 0,61 | 0,17 | -0,21 | -0,62 | -0,43 | -0,96 | -1,74 |
| 2019 | 0,93 | 0,54 | 0,45 | 0,85 | -0,16 | 0,25 | 0,27 | -0,47 | 0,50 | 0,25 | 0,44 | 0,19 | 4,12 |
| 2020 | 0,10 | -0,28 | -4,78 | 1,90 | 0,50 | 0,99 | 0,62 | 0,72 | -0,12 | -0,23 | 1,06 | 0,25 | 0,60 |
| 2021 | 0,18 | 0,32 | 0,20 | 0,47 | 0,05 | 0,22 | 0,11 | 0,40 | 0,25 | 0,35 | -0,71 | 0,90 | 2,77 |
| 2022 | -0,77 | -0,73 | 0,24 | -0,50 | -0,59 | -0,74 | 0,00 | 0,63 | -2,20 | 0,67 | 1,00 | 0,63 | -2,37 |
| 2023 | 0,89 | -0,11 | -1,03 | 0,68 | 0,17 | 0,34 | 0,85 | -0,02 | 0,05 | -0,28 | 1,95 | 1,68 | 5,26 |
| 2024 | 0,36 | -0,13 | 1,09 | 0,22 | - | - | - | - | - | - | - | - | 1,55 |

Analisi delle performance

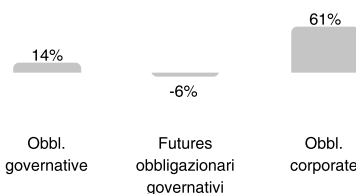
| | | | |
|---------------------------|--------|--------------------------|--------|
| Rendimento da inizio anno | 1,55% | Volatilità annualizzata | 2,13% |
| Rendimento dal lancio | 39,21% | Massimo drawdown | -8,72% |
| Indice di Sharpe | 0,73 | Tempo di recupero (mesi) | 7,90 |
| | | ESG score** | 70/100 |

** 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 |
|---|-------|
| CITIGROUP GLOBAL 16-30/09/2026 FRN | 7,87% |
| INT BK RECON&DEV 05-07/10/2025 FRN | 6,81% |
| HSBC BANK PLC 18-28/09/2024 FRN -FLAT | 5,56% |
| DEUTSCHE BK LOND 15-15/04/2025 FRN FLAT | 5,39% |
| INT BK RECON&DEV 16-31/05/2026 FRN | 5,06% |
| GS FIN C INTL 18-25/07/2028 FRN | 3,56% |
| GS FIN C INTL 17-11/07/2027 FRN | 3,41% |
| ITALY GOVT INT 05-09/11/2025 FRN | 3,17% |
| ITALY BTPS 1.4% 20-26/05/2025 | 3,13% |
| ANTHILIA BIT III A1 | 2,78% |

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.