

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Red

Classe B

Fondo flessibile azionario europeo (long bias)

Report al
5 luglio 2024



AnthiliaRed

Info fondo

| | |
|-----------------------|---------------|
| Gestore | Paolo Rizzo |
| AUM comparto (Mln €) | 40,38 € |
| Valuta di riferimento | Euro € |
| Frequenza NAV | Giornaliera |
| Tipo di OICR | SICAV UCITS V |
| Domicilio | Luxembourg |
| Depositaria | BNP Paribas |
| Revisore | Ernst&Young |
| Performance fee (%) | 20 |

Info classe

| | |
|----------------------|-------------------------|
| NAV (Valore quota) | 176,77 |
| Data di lancio | 2008-08-18 |
| ISIN Code | LU0374939022 |
| Bloomberg ticker | PLAREDB LX |
| Management fee (%) | 1.05 |
| Minimum investment | 250000 |
| 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

Anthilia Red adotta una strategia di investimento azionaria di tipo flessibile. Il comparto investe principalmente in titoli azionari dell'area dell'euro. La selezione delle opportunità di investimento si basa su tecniche di analisi macro e fondamentale. Il Gestore combina un modello macro multifattoriale basato su indicatori tecnici e fondamentali con un'accurata analisi bottom up dell'azienda target. Il Team incontra direttamente CEO e CFO delle aziende combinando le informazioni prodotte dal coverage dei broker con quelle ottenute tramite un accesso diretto al management delle aziende. Gli investimenti in mid e small cap (inferiori a 1 miliardo di EUR Mkt cap) non possono superare il 50% del valore patrimoniale netto del fondo. Il fondo può investire in derivati finanziari quotati per: copertura del rischio, gestione efficiente del portafoglio, finalità di investimento. L'esposizione al rischio globale attribuibile ai derivati finanziari non può superare il 50% del valore patrimoniale netto del fondo. La rigorosa gestione del rischio garantisce massima liquidità delle posizioni in portafoglio su base giornaliera.

Esposizione settoriale azionaria

| Settore | Peso |
|--|-------|
| Semiconduttori ed elettronica | 9,17% |
| Banche e altre istituzioni creditizie | 7,65% |
| Apparecchi elettronici e componenti | 7,64% |
| Internet, software & servizi IT | 7,41% |
| Cosmetica farmaceutica e prodotti medicinali | 6,12% |

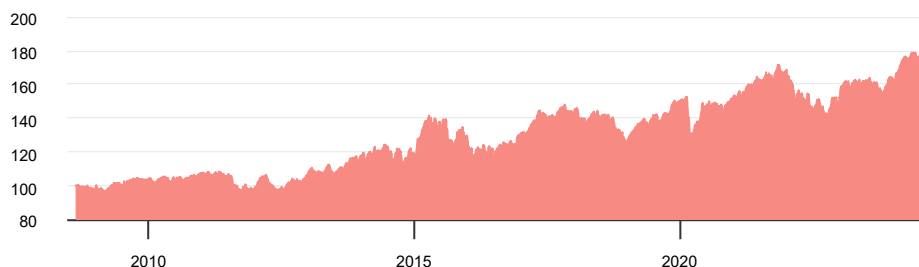
Esposizione geografica azionaria

| Paese d'origine | Peso |
|-----------------|--------|
| Francia | 25,89% |
| Italia | 18,33% |
| Germania | 15,86% |
| Paesi Bassi | 11,32% |
| Spagna | 4,41% |

Esposizione valutaria

| Valuta | Peso |
|--------|--------|
| EUR | 96,09% |
| CHF | 1,50% |
| USD | 1,48% |
| DKK | 0,52% |
| GBP | 0,49% |

NAV dal lancio



Rendimenti mensili - ultimi 10 anni

| Anno | Gen | Feb | Mar | Apr | Mag | Giu | Lug | Ago | Set | Ott | Nov | Dic | Tot |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 2014 | -2,14 | 3,62 | 1,24 | 0,07 | 0,69 | -0,79 | -1,77 | -0,44 | 0,69 | -4,18 | 5,96 | -2,28 | 0,27 |
| 2015 | 7,15 | 5,23 | 4,05 | -2,21 | 2,69 | -4,34 | 2,65 | -6,83 | -5,52 | 8,99 | 2,21 | -3,67 | 9,28 |
| 2016 | -6,75 | -1,62 | 2,72 | 1,68 | -0,16 | -5,35 | 4,09 | 2,04 | -0,74 | 2,31 | -1,51 | 4,56 | 0,58 |
| 2017 | 0,53 | 0,77 | 4,97 | 2,73 | 0,40 | -2,11 | 0,89 | -0,58 | 3,94 | 1,44 | -2,23 | -1,09 | 9,80 |
| 2018 | 1,26 | -3,03 | -2,27 | 2,97 | 0,29 | -1,47 | 1,93 | -0,20 | -0,69 | -6,97 | -0,05 | -5,36 | -13,18 |
| 2019 | 5,26 | 2,55 | 0,44 | 3,72 | -2,53 | 2,71 | 0,72 | -1,14 | 2,84 | 1,21 | 4,16 | -0,83 | 20,50 |
| 2020 | -0,48 | -4,36 | -7,84 | 5,60 | 4,11 | 0,77 | 0,55 | 1,65 | -1,17 | -3,30 | 5,68 | 1,73 | 2,05 |
| 2021 | -0,87 | 0,88 | 3,42 | 1,39 | 1,15 | 0,98 | 0,10 | 1,14 | -1,84 | 3,82 | -2,08 | 2,08 | 10,45 |
| 2022 | -4,83 | -3,44 | 0,94 | -2,98 | 2,32 | -5,48 | 0,00 | -0,05 | -5,08 | 4,77 | 3,87 | -0,78 | -10,84 |
| 2023 | 6,12 | 0,88 | 0,17 | 0,67 | -0,87 | 0,66 | 1,39 | -1,35 | -2,85 | -2,51 | 4,66 | 2,49 | 9,46 |
| 2024 | 1,77 | 2,72 | 2,99 | -0,67 | 1,07 | -1,36 | 1,14 | - | - | - | - | - | 7,82 |

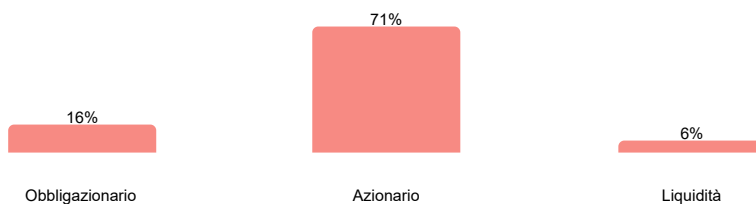
Analisi delle performance

| | | | |
|---------------------------|--------|---------------------------|---------|
| Rendimento da inizio anno | 7,82% | Volatilità annualizzata | 10,93% |
| Rendimento dal lancio | 76,77% | Massimo drawdown | -20,84% |
| Indice di Sharpe | 0,34 | Tempo di recupero (mesi) | 14,70 |
| Alpha * | 1,13% | Correlazione col mercato* | 0,80 |
| Beta * | 0,39 | ESG score** | 76/100 |

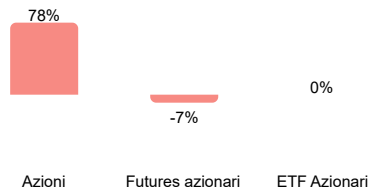
* statistiche di confronto calcolate in riferimento all'indice EURO STOXX 50 Net Return EUR

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

Composizione del portafoglio



Composizione azionaria



Top holdings

| Descrizione | Peso |
|------------------------------|-------|
| ASML HOLDING NV | 7,21% |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 4,03% |
| SAP SE | 3,93% |
| TOTALENERGIES SE | 3,40% |
| SIEMENS AG-REG | 2,86% |
| SAES GETTERS SPA | 2,44% |
| SANOFI | 2,36% |
| LOREAL | 2,36% |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 2,34% |
| CYBEROO SPA | 2,21% |

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.