Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Silver
Planetarium Sicav
Fondo Long / Short Equity Europa

Weekly Report 27 luglio 2018
www.anthilia.it

Anthilia Silver

Gestori	Simone Chelini Pietropaolo Rinaldi
AUM comparto (Mln €)	29,9
Valuta di riferimento	Euro
Frequenza del NAV	Giornaliera
Tipo di OICR	SICAV UCITS V
Domicilio	Lussemburgo
Depositaria	RBC Investor Services
Revisore	EY
Management fee (%) B	1,50
Perfomance fee (%)	20 (high watermark perpetuo)
Investimento minimo	€ 250.000 classe B

Classe B (Istituzionale)

NAV (Valore quota)	**87,98**
Data di lancio	12 aprile 2016
ISIN Code	LU1377525495
Bloomberg ticker	PLSILVB LX
Contatti	info@anthilia.it www.anthilia.it
Swiss Representative:	ACOLIN Fund Services AG
Swiss Paying Agent:	PKB Privatbank AG
Publications:	www.fundinfo.com

Profilo di rischio

Basso rischio — Alto rischio

1 2 3 4 5 6 7

Rischio medio

Politica di investimento

Il comparto mira a conseguire un rendimento assoluto nel lungo termine attraverso una strategia basata principalmente sull'esposizione lunga e corta alle azioni europee. Le posizioni in strumenti di capitale saranno assunte sia attraverso l'acquisto di titoli azionari sia attraverso l'utilizzo di CFD (Contratti per Differenza) su singole azioni o su indici azionari (settoriali e/o geografici). Il comparto può inoltre utilizzare - per scopo di investimento, di copertura dei rischi e di efficiente gestione del portafoglio - strumenti derivati quotati quali future e opzioni.
L'obiettivo del fondo è generare performance non strettamente correlata all'andamento dell'indice azionario europeo. La volatilità del fondo è attesa nel medio termine non superiore al 10% su base annua.

Monitor Posizioni

Totale Posizioni	**72**
Posizioni Lunghe	45
Posizioni Corte	27

Posizioni lunghe (prime 10)

Titolo	Peso (%)
BUZZI UNICEM SPA-RSP	7,9
SALVATORE FERRAGAMO SPA	3,6
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	3,3
ABITARE IN SPA	2,0
BANCA FARMAFACTORING SPA	1,5
CAPITAL FOR PROGRESS 2 SPA	1,3
BAYER AG-REG	1,3
CFD PENNON GROUP PLC	1,2
MEDIOBANCA	1,1
BANCA MEDIOLANUM SPA	1,1

NAV dal lancio

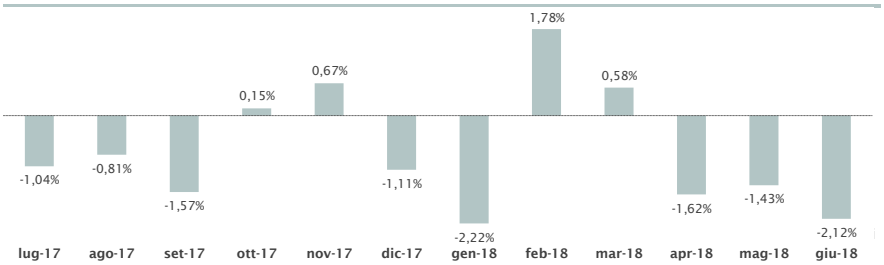
Rendimenti mensili

	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Anno
2016	-	-	-	+0,38	-0,69	-1,54	+1,09	-0,78	-0,39	+2,03	-2,01	+0,78	**-1,19**
2017	-0,29	-0,55	+0,99	-0,90	+0,07	-0,39	-1,04	-0,81	-1,57	+0,15	+0,67	-1,11	**-4,72**
2018	-2,22	+1,78	+0,58	-1,62	-1,43	-2,12	-1,63						**-6,55**

Analisi della performance

Rendimento da inizio anno	-6,55%	Volatilità annualizzata	5,16%
Rendimento dal lancio	-12,02%	VaR mensile 99%	3,30%
Indice di Sharpe	-0,97	Massimo drawdown	-13,27%
Alpha	-4,61%	Tempo di recupero (mesi)	-
Beta	-0,06	Correlazione col mercato	-0,15

Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio

Esposizione Equity totale		Book Long		Book Short	
Lunga	44,8%	Titoli	43,7%	Titoli	-34,9%
Corta	-55,4%	Derivati	1,0%	Derivati	-20,6%
Netta	-10,7%	Totale	44,8%	Totale	-55,4%

Breakdown Equity per Paese (Top 5)

	Long	Short	Net	Gross
Italy	40,9	25,7	15,2	66,6
United States	0,2	12,2	-12,0	12,5
Germany	7,2	3,9	3,4	11,1
Switzerland	0,8	3,8	-3,1	4,6
Britain	1,2	1,9	-0,8	3,1

Breakdown Equity per Settore (Top 10)

	Long	Short	Net	Gross
Financials	13,5	7,7	5,8	21,2
Materials	9,8	11,2	-1,4	21,1
Consumer Staples	5,6	6,0	-0,4	11,7
Consumer Discretionary	4,8	4,4	0,4	9,3
Industrials	1,8	4,5	-2,6	6,3
Health Care	1,5	1,0	0,5	2,5
Utilities	1,4	0,0	1,4	1,4
Information Technology	1,0	0,0	1,0	1,0
Telecommunication Servic	0,9	0,0	0,9	0,9

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.