

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Silver Planetarium Sicav

Fondo Long / Short Equity Europa

Weekly Report

27 dicembre 2019

www.anthilia.it



Anthilia Silver

| | |
|-----------------------|------------------------------|
| Gestori | Pietro Paolo Rinaldi |
| AUM comparto (Mln €) | 8,5 |
| 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 | 1,85 |
| Performance fee (%) | 20 (high watermark perpetuo) |
| Investimento minimo | Nessuno classe A |

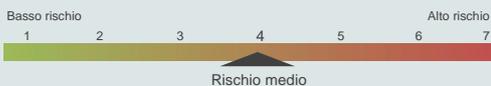
Classe A (Retail)

| | |
|--------------------|--------------|
| NAV (Valore quota) | 106,33 |
| Data di lancio | 23/11/2018 |
| ISIN Code | LU1377525222 |
| Bloomberg ticker | PLSILVA 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



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.

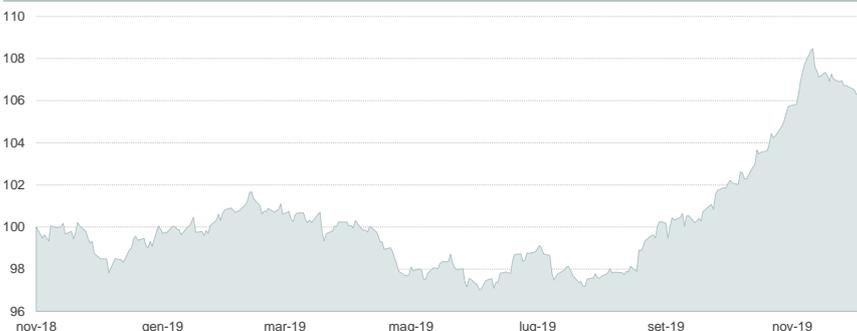
Monitor Posizioni

| | |
|------------------|----|
| Totale Posizioni | 56 |
| Posizioni Lunghe | 37 |
| Posizioni Corte | 19 |

Posizioni lunghe (prime 10)

| Titolo | Peso (%) |
|------------------------------|----------|
| BTPS 1 1/4 10/27/20 | 9,6 |
| BTPS 4 09/01/20 | 8,6 |
| BTPS 1.65 04/23/20 | 7,7 |
| BASICNET SPA | 5,7 |
| CFD TELIT COMMUNICATIONS PLC | 4,9 |
| GAROFALO HEALTH CARE SPA | 4,7 |
| SAES GETTERS SPA | 4,4 |
| CFD OENEO SA | 4,0 |
| NVP SPA | 3,3 |
| ABITARE IN SPA | 3,2 |

NAV dal lancio



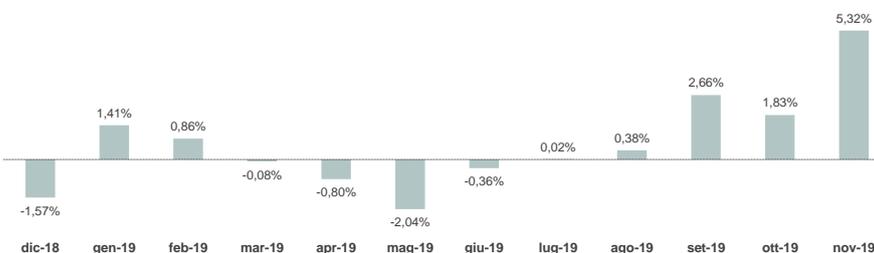
Rendimenti mensili

| | Gen | Feb | Mar | Apr | Mag | Giu | Lug | Ago | Set | Ott | Nov | Dic | Anno |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2018 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | +0,06 | -1,57 | -1,51 |
| 2019 | +1,41 | +0,86 | -0,08 | -0,80 | -2,04 | -0,36 | +0,02 | +0,38 | +2,66 | +1,83 | +5,32 | -1,30 | +7,96 |

Analisi della performance

| | | | |
|---------------------------|--------|--------------------------|--------|
| Rendimento da inizio anno | +7,96% | Volatilità annualizzata | 4,62% |
| Rendimento dal lancio | +6,33% | VaR mensile 99% | 4,04% |
| Indice di Sharpe | 1,43 | Massimo drawdown | -4,57% |
| Alpha | 4,84% | Tempo di recupero (mesi) | 7,27 |
| Beta | 0,09 | Correlazione col mercato | 0,19 |

Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio

| Esposizione Equity totale | | Book Long | | Book Short | |
|---------------------------|--------|-----------|-------|------------|--------|
| Lunga | 54,7% | Titoli | 54,7% | Titoli | -13,5% |
| Corta | -28,5% | Derivati | 0,0% | Derivati | -15,0% |
| Netta | 26,3% | Totale | 54,7% | Totale | -28,5% |

Breakdown Equity per Paese (Top 5)

| | Long | Short | Net | Gross |
|-------------|------|-------|------|-------|
| Italy | 67,4 | 6,9 | 60,5 | 74,3 |
| France | 7,5 | 7,6 | -0,1 | 15,2 |
| Britain | 4,9 | 2,5 | 2,4 | 7,4 |
| Germany | 4,6 | 0,0 | 4,6 | 4,6 |
| Switzerland | 0,8 | 0,0 | 0,8 | 0,8 |

Breakdown Equity per Settore (Top 10)

| | Long | Short | Net | Gross |
|------------------------|------|-------|-----|-------|
| Consumer Discretionary | 11,0 | 3,7 | 7,3 | 14,6 |
| Consumer Staples | 11,3 | 2,4 | 8,9 | 13,8 |
| Industrials | 11,0 | 2,7 | 8,3 | 13,7 |
| Information Technology | 10,1 | 1,4 | 8,7 | 11,5 |
| Financials | 3,5 | 1,2 | 2,3 | 4,7 |
| Materials | 2,9 | 0,0 | 2,9 | 2,9 |

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.