Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Silver
Planetarium Sicav
Fondo Long / Short Equity Europa

Weekly Report **24 dicembre 2020**
www.anthilia.it

AnthiliaSilver

Anthilia Silver

Gestori	Pietropaolo Rinaldi
AUM comparto (Mln €)	9,8
Valuta di riferimento	Euro
Frequenza del NAV	Giornaliera
Tipo di OICR	SICAV UCITS V
Domicilio	Lussemburgo
Depositaria	RBC Investor Services
Revisore	EY
Management fee (%) A	1,85
Perfomance fee (%)	20 (high watermark perpetuo)
Investimento minimo	Nessuno classe A

Classe A (Retail)

NAV (Valore quota)	**112,27**
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

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	**67**
Posizioni Lunghe	56
Posizioni Corte	11

Posizioni lunghe (prime 10)

Titolo	Peso (%)
TELIT COMMUNICATIONS PLC	7,2
BTPS 4 3/4 09/01/21	5,4
EUROTECH SPA	3,8
ZALANDO SE	3,1
ABITARE IN SPA	3,0
SAES GETTERS SPA	3,0
GAROFALO HEALTH CARE SPA	2,7
SERI INDUSTRIAL	2,7
NVP SPA	2,7
BTPS 0.05 04/15/21	2,6

NAV dal lancio

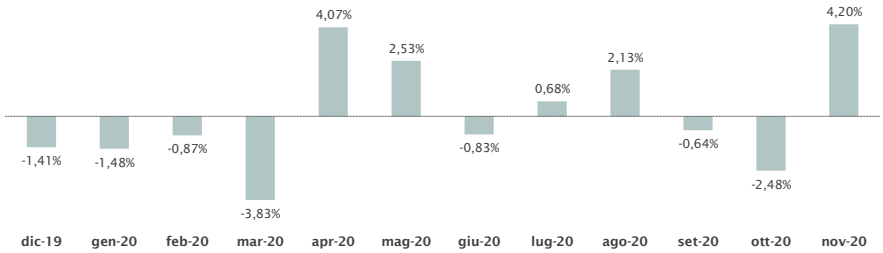
Rendimenti mensili

	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	-1,41	**+7,84**
2020	-1,48	-0,87	-3,83	+4,07	+2,53	-0,83	+0,68	+2,13	-0,64	-2,48	+4,20	+2,44	**+5,71**

Analisi della performance

Rendimento da inizio anno	+5,71%	Volatilità annualizzata	6,43%
Rendimento dal lancio	+12,27%	VaR mensile 99%	7,86%
Indice di Sharpe	0,96	Massimo drawdown	-12,18%
Alpha	5,03%	Tempo di recupero (mesi)	8,73
Beta	0,15	Correlazione col mercato	0,49

Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio

Esposizione Equity totale		Book Long		Book Short	
Lunga	65,3%	Titoli	65,3%	Titoli	-6,7%
Corta	-25,6%	Derivati	0,0%	Derivati	-18,9%
Netta	39,8%	Totale	65,3%	Totale	-25,6%

Breakdown Equity per Paese (Top 5)

	Long	Short	Net	Gross
Italy	56,1	9,3	46,8	65,3
Britain	10,8	0,0	10,8	10,8
Germany	10,4	0,0	10,4	10,4
Switzerland	0,0	1,7	-1,7	1,7
Netherlands	0,9	0,0	0,9	0,9

Breakdown Equity per Settore (Top 10)

	Long	Short	Net	Gross
Information Technology	16,2	2,0	14,1	18,2
Industrials	6,6	0,3	6,3	6,8
Financials	6,6	0,2	6,4	6,8
Consumer Staples	6,2	0,0	6,2	6,2
Consumer Discretionary	3,3	0,0	3,3	3,3
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.