Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Silver

Planetarium Sicav

Fondo Long / Short Equity Europa

Anthilia Silver

Pietropaolo Rinaldi 10.0 AUM comparto (MIn €) Euro Valuta di riferimento Frequenza del NAV Tipo di OICR Giornaliera Domicilio

Depositaria Revisore Management fee (%) A Perfomance fee (%) Investimento minimo

1.85

SICAV UCITS V Lussemburgo **RBC** Investor Services

20 (high watermark perpetuo) Nessuno

Classe A (Retail)

NAV (Valore quota) Data di lancio ISIN Code Bloomberg ticker

113,53 23/11/2018 LU1377525222 PLSILVA LX info@anthilia.it

Contatti Swiss Representative: Swiss Paying Agent: Publications

www.anthilia.it ACOLIN Fund Services AG PKB Privatbank AG www.fundinfo.com

Profilo di rischio



Rischio medio

Politica di investimento

Il comparto mira a conseguire un rendimento assoluto nel lungo 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 | 51 |
| Posizioni Corte | 16 |

Posizioni lunghe (prime 10)

| Titolo | Peso (%) |
|--------------------------|----------|
| TELIT COMMUNICATIONS PLC | 5,8 |
| DIGITAL BROS SPA | 3,5 |
| EUROTECH SPA | 3,2 |
| BTPS 4 3/4 09/01/21 | 3,1 |
| SERI INDUSTRIAL | 3,0 |
| GAROFALO HEALTH CARE SPA | 3,0 |
| ABITARE IN SPA | 3,0 |
| SAES GETTERS SPA | 3,0 |
| BTPS 0.05 04/15/21 | 2,5 |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | 2,5 |

Weekly Report

19 febbraio 2021

www.anthilia.it



NAV dal lancio



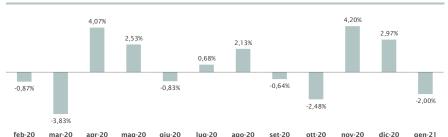
Rendimenti mensili

| | 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 | +2,97 | +6,26 |
| 2021 | -2.00 | +2.65 | | | | | | | | | | | +0.59 |

Analisi della performance

| Rendimento da inizio anno | +0,59% | Volatilità annualizzata | 6,43% |
|---------------------------|---------|--------------------------|---------|
| Rendimento dal lancio | +13,53% | VaR mensile 99% | 6,88% |
| Indice di Sharpe | 0,97 | Massimo drawdown | -12,18% |
| Alpha | 4,84% | Tempo di recupero (mesi) | 8,73 |
| Beta | 0,15 | Correlazione col mercato | 0,48 |

Rendimenti mensili ultimi 12 mesi



Composizione del portafoglio

| Esposizione I | e Equity totale Book Long | | | Book Short | | |
|---------------|---------------------------|----------|-------|------------|--------|--|
| Lunga | 61,7% | Titoli | 61,7% | Titoli | -3,6% | |
| Corta | -23,3% | Derivati | 0,0% | Derivati | -19,7% | |
| Netta | 38.4% | Totale | 61.7% | Totale | -23.3% | |

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.