

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Silver

Classe A
Fondo Long / Short Equity Europa

Report al
14 luglio 2023



Info fondo

Gestore	Pietro Paolo Rinaldi
AUM comparto (Mln €)	12,56 €
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)	111,86
Data di lancio	2018-11-23
ISIN Code	LU1377525222
Bloomberg ticker	PLSILVA LX
Management fee (%)	1,85
Minimum investment	none
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

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	70
Posizioni lunghe	43
Posizioni corte	27

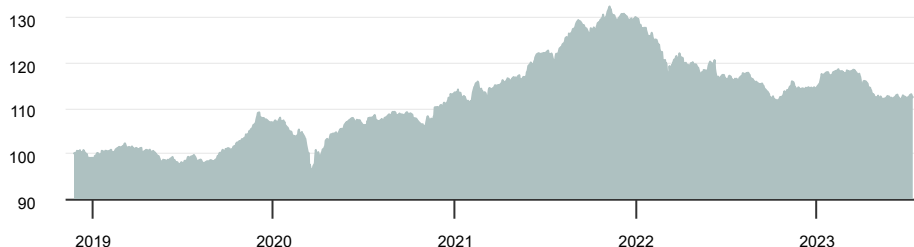
Titoli azionari (primi 10)

Titolo	Peso
SAES GETTERS SPA	6,45%
SOMEK SPA	4,86%
SERI INDUSTRIAL SPA	3,73%
NVP SPA	3,49%
CYBEROO SPA	3,29%
GAROFALO HEALTH CARE SPA	3,09%
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	2,94%
REWAY GROUP SPA	2,77%
SCIUKER FRAMES SPA	2,55%
ABITARE IN SPA	2,54%

Breakdown Equity per paese (Top 5)

	Long	Short	Net	Gross
IT	69,93%	12,73%	57,19%	82,66%
DE	0,00%	8,37%	-8,37%	8,37%
NL	2,12%	1,07%	1,05%	3,19%
GR	2,94%	0,00%	2,94%	2,94%
FR	2,61%	0,00%	2,61%	2,61%

NAV dal lancio



Rendimenti mensili - ultimi 10 anni

Anno	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Tot
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	2,05	1,32	1,39	2,34	2,42	0,44	4,11	-1,16	2,75	0,36	-0,08	14,66
2022	-3,25	-4,33	1,17	-1,84	0,58	-2,96	0,00	-0,95	-3,35	1,38	0,63	0,16	-12,23
2023	2,66	0,35	-1,18	-3,28	-0,31	0,14	0,20	-	-	-	-	-	-1,51

Analisi delle performance

Rendimento da inizio anno	-1,51%	Volatilità annualizzata	6,11%
Rendimento dal lancio	11,86%	Massimo drawdown	-16,03%
Indice di Sharpe	0,43	Tempo di recupero (mesi)	0,00
Alpha*	1,54%	Correlazione col mercato*	0,47
Beta*	0,16	ESG score**	55/100

* statistiche di confronto calcolate in riferimento all'indice STOXX Europe 600 Price Index EUR

** Lo score ESG sintetizza aspetti ambientali, sociali e di governance attraverso un valore da 0 a 100 (non investibile, massimamente virtuosa)

Esposizione equity totale

	Book Long	Book short
Lunga	51,41%	Titoli 47,35%
Corta	-29,35%	Derivati 4,06%
Netta	22,06%	Totale 51,41%
		Derivati -14,14%
		Totale -25,29%

Breakdown equity per settore

	Long	Short	Net	Gross
Stato & governo centrale	22,39%	0,00%	22,39%	22,39%
Apparecchi elettronici e componenti	10,77%	0,00%	10,77%	10,77%
Materiali edili e costruzioni	10,25%	0,00%	10,25%	10,25%
Società finanziarie, d'investimento e altre	6,32%	0,00%	6,32%	6,32%
Banche e altre istituzioni creditizie	4,80%	1,07%	3,72%	5,87%
Internet, software & servizi IT	4,68%	0,00%	4,68%	4,68%
Telecomunicazioni	4,28%	0,00%	4,28%	4,28%
Salute e servizi sociali	3,09%	0,00%	3,09%	3,09%
Servizi vari	3,09%	0,00%	3,09%	3,09%
Industria alberghiera, di catering e attrezzature per il tempo libero	2,24%	0,49%	1,75%	2,73%