

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Silver

Classe A
Fondo Long / Short Equity Europa

Report al
13 ottobre 2023



Info fondo

Gestore	Pietro Paolo Rinaldi
AUM comparto (Mln €)	11,03 €
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)	107,52
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	47
Posizioni lunghe	35
Posizioni corte	12

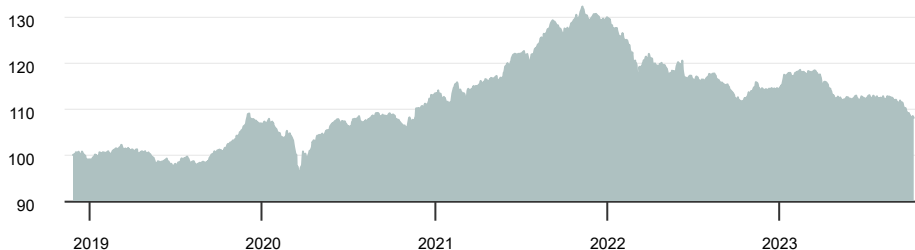
Titoli azionari (primi 10)

Titolo	Peso
SAES GETTERS SPA	6,89%
SOMEK SPA	5,25%
NVP SPA	3,72%
CYBEROO SPA	3,33%
DANIELI & CO	2,88%
SERI INDUSTRIAL SPA	2,72%
DIGITAL BROS	2,24%
GAROFALO HEALTH CARE SPA	2,06%
REWAY GROUP SPA	2,01%
HOMIZY SIIQ SPA	1,59%

Breakdown Equity per paese (Top 5)

	Long	Short	Net	Gross
IT	61,90%	8,17%	53,73%	70,07%
DE	0,00%	5,95%	-5,95%	5,95%
CH	0,00%	1,13%	-1,13%	1,13%
SE	0,00%	0,99%	-0,99%	0,99%
FR	0,79%	0,00%	0,79%	0,79%

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	0,13	-0,19	-2,54	-1,12	-	-	-5,33

Analisi delle performance

Rendimento da inizio anno	-5,33%	Volatilità annualizzata	6,02%
Rendimento dal lancio	7,52%	Massimo drawdown	-18,38%
Indice di Sharpe	0,28	Tempo di recupero (mesi)	0,00
Alpha*	1,06%	Correlazione col mercato*	0,46
Beta*	0,15	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 (minimo) a 100 (massimo)

Esposizione equity totale

	Book Long	Book short
Lunga	39,17%	Titoli -5,22%
Corta	-16,25%	Derivati -11,03%
Netta	22,92%	Totale -16,25%

Breakdown equity per settore

	Long	Short	Net	Gross
Stato & governo centrale	20,67%	0,00%	20,67%	20,67%
Apparecchi elettronici e componenti	10,41%	0,00%	10,41%	10,41%
Materiali edili e costruzioni	8,81%	0,00%	8,81%	8,81%
Telecomunicazioni	5,96%	0,00%	5,96%	5,96%
Internet, software & servizi IT	4,91%	0,00%	4,91%	4,91%
Macchine e apparati industriali	2,88%	0,00%	2,88%	2,88%
Salute e servizi sociali	2,06%	0,00%	2,06%	2,06%
Banche e altre istituzioni creditizie	2,05%	0,00%	2,05%	2,05%
Industria alberghiera, di catering e attrezzature per il tempo libero	1,81%	0,00%	1,81%	1,81%
Società finanziarie, d'investimento e altre	1,16%	0,58%	0,59%	1,74%