

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Silver

Classe A
Fondo Long / Short Equity Europa

Report al
20 ottobre 2023



Info fondo

Gestore	Pietro Paolo Rinaldi
AUM comparto (Mln €)	7,23 €
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)	106,89
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	45
Posizioni lunghe	31
Posizioni corte	14

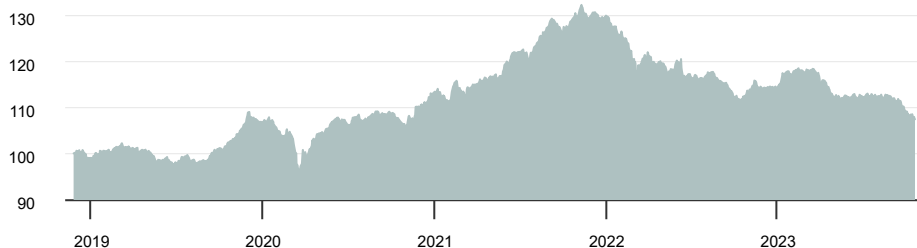
Titoli azionari (primi 10)

Titolo	Peso
SAES GETTERS SPA	9,23%
NVP SPA	5,59%
SOMEC SPA	5,34%
SERI INDUSTRIAL SPA	4,29%
DANIELI & CO	3,69%
CYBEROO SPA	3,39%
DIGITAL BROS	3,19%
GAROFALO HEALTH CARE SPA	2,99%
REWAY GROUP SPA	2,45%
HOMIZY SIIQ SPA	2,42%

Breakdown Equity per paese (Top 5)

	Long	Short	Net	Gross
IT	62,53%	12,34%	50,20%	74,87%
DE	0,00%	8,57%	-8,57%	8,57%
SE	0,00%	1,78%	-1,78%	1,78%
FR	1,11%	0,54%	0,57%	1,65%
CH	0,00%	1,47%	-1,47%	1,47%

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	-1,70	-	-	-5,88

Analisi delle performance

Rendimento da inizio anno	-5,88%	Volatilità annualizzata	6,03%
Rendimento da lancio	6,89%	Massimo drawdown	-18,86%
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	51,95%	Titoli -8,80%
Corta	-24,70%	Derivati -15,90%
Netta	27,25%	Totale -24,70%

Breakdown equity per settore

	Long	Short	Net	Gross
Apparecchi elettronici e componenti	14,62%	0,00%	14,62%	14,62%
Materiali edili e costruzioni	9,95%	0,00%	9,95%	9,95%
Stato & governo centrale	8,85%	0,00%	8,85%	8,85%
Telecomunicazioni	8,78%	0,00%	8,78%	8,78%
Internet, software & servizi IT	5,81%	0,00%	5,81%	5,81%
Macchine e apparati industriali	3,69%	0,00%	3,69%	3,69%
Società finanziarie, d'investimento e altre	1,36%	1,74%	-0,38%	3,11%
Banche e altre istituzioni creditizie	3,00%	0,00%	3,00%	3,00%
Salute e servizi sociali	2,99%	0,00%	2,99%	2,99%
Petrolio / gas naturale	2,12%	0,00%	2,12%	2,12%

Questo documento non costituisce sollecitazione e non rappresenta un'offerta formale all'acquisto o alla sottoscrizione di strumenti finanziari. Qualsiasi ricerca o analisi presente in questo documento è basata su fonti ritenute affidabili, ma non vi è garanzia sull'accuratezza e completezza di tali fonti. Ogni opinione, stima o previsione può essere modificata in qualsiasi momento senza preavviso. Questo documento non è destinato alla distribuzione a investitori retail e non è diretto a persone fisiche o giuridiche che siano cittadini o residenti o aventi sede in luoghi, regioni, paesi o altre giurisdizioni dove tale distribuzione, pubblicazione, disponibilità o uso siano contrari a leggi o regolamentazioni. I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. Questo documento è prodotto da Anthilia Capital Partners SGR Spa per uso interno e non può essere riprodotto o distribuito, sia parzialmente che integralmente, senza autorizzazione da parte di Anthilia Capital Partners SGR Spa.