

Anthilia Capital Partners SGR

Anthilia Silver

Classe A
Fondo Long / Short Equity Europa

Report al
27 ottobre 2023



Info fondo

Gestore	Pietro Paolo Rinaldi
AUM comparto (Mln €)	7,09 €
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)	105,00
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	39
Posizioni lunghe	29
Posizioni corte	10

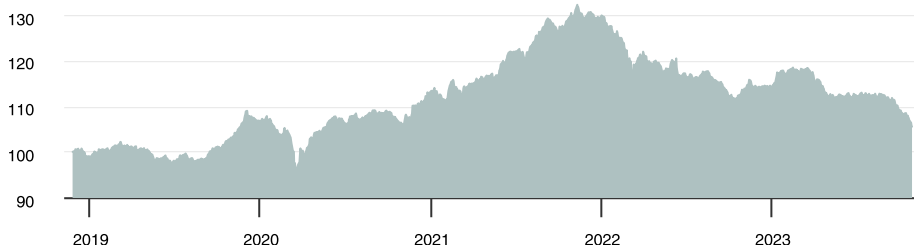
Titoli azionari (primi 10)

Titolo	Peso
SAES GETTERS SPA	8,51%
SOMEK SPA	4,80%
NVP SPA	3,94%
SERI INDUSTRIAL SPA	3,88%
CYBERO SPA	3,35%
DIGITAL BROS	3,22%
DANIELI & CO	2,65%
HOMIZY SIIQ SPA	2,47%
REWAY GROUP SPA	2,38%
GAROFALO HEALTH CARE SPA	2,12%

Breakdown Equity per paese (Top 5)

	Long	Short	Net	Gross
IT	60,38%	10,52%	49,86%	70,89%
DE	0,00%	6,41%	-6,41%	6,41%
CH	0,00%	1,44%	-1,44%	1,44%
SE	0,00%	1,12%	-1,12%	1,12%
FR	0,99%	0,00%	0,99%	0,99%

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	-3,44	-	-	-7,55

Analisi delle performance

Rendimento da inizio anno	-7,55%	Volatilità annualizzata	6,03%
Rendimento da lancio	5,00%	Massimo drawdown	-20,29%
Indice di Sharpe	0,27	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	43,99%	Titoli 43,63%
Corta	-19,49%	Derivati 0,36%
Netta	24,50%	Totale 43,99%
		Derivati -13,73%
		Totale -19,49%

Breakdown equity per settore

	Long	Short	Net	Gross
Stato & governo centrale	15,88%	0,00%	15,88%	15,88%
Apparecchi elettronici e componenti	13,38%	0,00%	13,38%	13,38%
Materiali edili e costruzioni	9,08%	0,00%	9,08%	9,08%
Telecomunicazioni	7,15%	0,00%	7,15%	7,15%
Internet, software & servizi IT	5,82%	0,00%	5,82%	5,82%
Banche e altre istituzioni creditizie	3,06%	0,00%	3,06%	3,06%
Macchine e apparati industriali	2,65%	0,00%	2,65%	2,65%
Salute e servizi sociali	2,12%	0,00%	2,12%	2,12%
Società finanziarie, d'investimento e altre	1,35%	0,76%	0,59%	2,11%
Biotechnologia	1,68%	0,00%	1,68%	1,68%

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.