

# Anthilia Capital Partners SGR

## Anthilia Silver

Classe A  
Fondo Long / Short Equity Europa

Report al  
5 aprile 2024



AnthiliaSilver

### Info fondo

|                       |               |
|-----------------------|---------------|
| Gestore               | Paolo Rizzo   |
| AUM comparto (Mln €)  | 6,24 €        |
| 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)   | 113,53                  |
| 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 | 55 |
| Posizioni lunghe | 55 |
| Posizioni corte  | 0  |

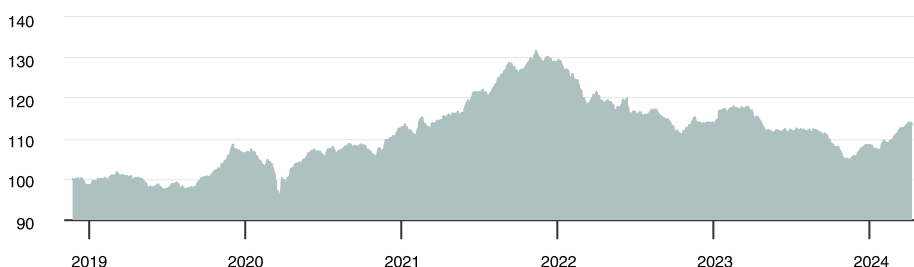
### Titoli azionari (primi 10)

| Titolo                       | Peso  |
|------------------------------|-------|
| ASML HOLDING NV              | 5,33% |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 4,85% |
| CYBEROO SPA                  | 3,96% |
| SAES GETTERS SPA             | 3,67% |
| HOMIZY SIIQ SPA              | 2,82% |
| LOREAL                       | 2,69% |
| TOTALENERGIES SE             | 2,65% |
| LEONARDO SPA                 | 2,48% |
| DANIELI & CO                 | 2,33% |
| SIEMENS AG-REG               | 2,28% |

### Breakdown Equity per paese (Top 5)

|    | Long   | Short | Net    | Gross  |
|----|--------|-------|--------|--------|
| IT | 37,28% | 0,00% | 37,28% | 37,28% |
| FR | 25,23% | 0,00% | 25,23% | 25,23% |
| DE | 11,68% | 0,00% | 11,68% | 11,68% |
| NL | 7,15%  | 0,00% | 7,15%  | 7,15%  |
| ES | 3,55%  | 0,00% | 3,55%  | 3,55%  |

### 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 | -3,45 | 1,24 | 1,85  | -4,68  |
| 2024 | 1,07  | 1,39  | 2,63  | -0,29 | -     | -     | -    | -     | -     | -     | -    | -     | 4,87   |

### Analisi delle performance

|                           |        |                           |         |
|---------------------------|--------|---------------------------|---------|
| Rendimento da inizio anno | 4,87%  | Volatilità annualizzata   | 5,96%   |
| Rendimento dal lancio     | 13,53% | Massimo drawdown          | -20,78% |
| Indice di Sharpe          | 0,33   | Tempo di recupero (mesi)  | 0,00    |
| Alpha*                    | 1,26%  | Correlazione col mercato* | 0,46    |
| Beta*                     | 0,16   | ESG score**               | 66/100  |

\* 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                     | 72,65%    | Titoli     | 72,65% | Titoli   | 0,00% |
| Corta                     | 0,00%     | Derivati   | 0,00%  | Derivati | 0,00% |
| Netta                     | 72,65%    | Totale     | 72,65% | Totale   | 0,00% |

### Breakdown equity per settore

|  | Long   | Short | Net    | Gross  |
|--|--------|-------|--------|--------|
| Stato & governo centrale                     | 11,75% | 0,00% | 11,75% | 11,75% |
| Internet, software & servizi IT              | 8,68%  | 0,00% | 8,68%  | 8,68%  |
| Banche e altre istituzioni creditizie        | 8,18%  | 0,00% | 8,18%  | 8,18%  |
| Apparecchi elettronici e componenti          | 7,28%  | 0,00% | 7,28%  | 7,28%  |
| Semiconduttori ed elettronica                | 6,30%  | 0,00% | 6,30%  | 6,30%  |
| Cosmetica farmaceutica e prodotti medicinali | 5,64%  | 0,00% | 5,64%  | 5,64%  |
| Industria aeronautica & spaziale             | 5,42%  | 0,00% | 5,42%  | 5,42%  |
| Servizi vari                                 | 4,85%  | 0,00% | 4,85%  | 4,85%  |
| Petrolio/ gas naturale                       | 4,65%  | 0,00% | 4,65%  | 4,65%  |
| Veicoli                                      | 4,21%  | 0,00% | 4,21%  | 4,21%  |

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.