

SANTALUCIA RENTA FIJA, FI D

FICHA MENSUAL | Noviembre 2018

Gestora SANTALUCIA ASSET MANAGEMENT
Tipo VDOS RENTA FIJA
Categoría VDOS RF EURO LARGO PLAZO

Rating VDOS ★★★★★
Rango de volatilidad ●● Entre 2% y 5%

Características

Datos identificativos

ISIN ES0170138020
Divisa EURO
Gestora SANTALUCIA ASSET MANAGEMENT
Grupo financiero SANTALUCIA
Depositaria BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, SUCURSAL EN ESPAÑA
Auditor PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES, S.L.

Comisiones

Fija 0,35%
Variable 0,00%
Depósito 0,06%
Suscripción 0,00%
Reembolso 0,00%

Política de inversión

El Fondo tendrá el 100% de su exposición total en activos de renta fija pública y/o privada (incluyendo depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, líquidos). Los emisores y mercados serán principalmente de la zona euro y minoritariamente de la OCDE pudiendo invertir puntualmente hasta un 10% de la exposición total en emisores/mercados emergentes. La duración media de la cartera oscilará entre 2 - 8 años. No existe predeterminación en cuanto a la calificación crediticia de los emisores/ emisiones. La exposición al riesgo divisa será como máximo del 5% de la exposición total. Se podrá invertir hasta un 10% del patrimonio en IICs financieras de renta fija, que sean activo apto, armonizadas o no, del Grupo o no de la Gestora. De forma directa, solo se realiza operativa con derivados cotizados en mercados organizados (no se hacen OTC), aunque de forma indirecta (a través de IICs), se podrán utilizar derivados cotizados o no en mercados organizados.

Otras características

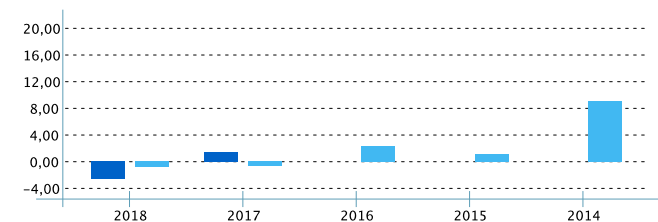
Aportación mínima 1.000,00 EUR
Mínimo a mantener 0,00 EUR
Referencia Bloomberg/EFFAS Bond Indices TR Euro Govt 3-5 años (40%) + Iboxx Corporate TR 3-5 años (40%) + Iboxx Corporate TR EUR Liquid High Yield (15%) + Índice AFI de repo día sobre gobierno español (5%)

Rentabilidades

Anuales

	2018	2017	2016	2015	2014
Fondo	-2,58%	1,45%	-	-	-
Categoría	-0,80%	-0,68%	2,32%	1,15%	9,02%
Ranking	473/630	111/574	-	-	-
Quintil	4	1	-	-	-

Cálculos realizados en divisa EUR

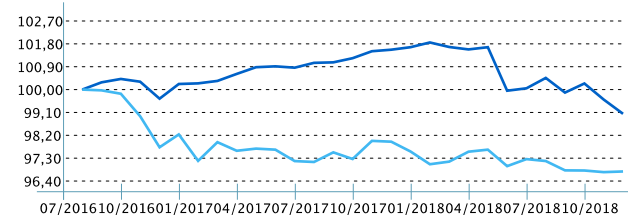


— SANTALUCIA RENTA FIJA, FI D
— RF EURO LARGO PLAZO

Acumuladas

	3 meses	6 meses	12 meses	3 años	5 años
Fondo	-0,84%	-0,91%	-2,48%	-	-
Categoría	-0,04%	-0,22%	-1,20%	-0,36%	10,60%
Ranking	448/667	384/661	350/620	-	-
Quintil	4	3	3	-	-

Cálculos realizados en divisa EUR



— SANTALUCIA RENTA FIJA, FI D
— RF EURO LARGO PLAZO

Evolución histórica: Periodo: 31/07/2016 - 30/11/2018

Última valoración

Valor liquidativo 19,096900 EUR
Patrimonio (Clase D) 628,66 (En miles de euros)
Patrimonio del fondo 200.900,27 (En miles de euros)
Participes (Clase D) -
Participes del fondo -
Fecha 30/11/2018

Análisis (a 3 años)

Rentabilidad/Riesgo

Rentabilidad anualizada -
Volatilidad -

Ratios CML

Sharpe -
Información -
Tracking Error -

Ratios SML

Treynor -
Alfa -
Beta -

Criterios de cálculo: **Muestra:** 12 datos trimestrales tomados hasta el último trimestre cerrado. **Activo libre de riesgo:** AFI REPOS 1 DIA. **Benchmark de mercado:** RF EURO LARGO PLAZO. **Divisa:** EUR.

Datos del Registro Oficial

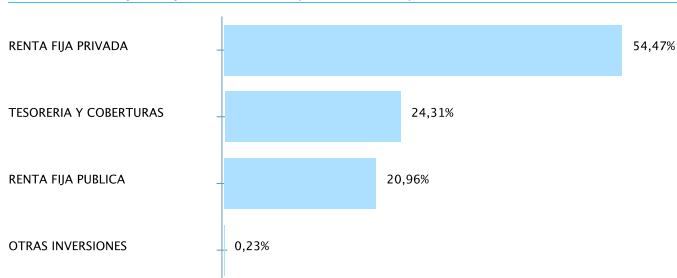
Fondo	Gestora	Depositaria
Ley 46/2002 Art. 40 A	SANTA LUCÍA GESTIÓN, SGIIC, S.A.	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, SUCURSAL EN ESPAÑA
Fecha de constitución 30/01/2001	Nº registro oficial 225	Nº registro oficial 206
Fecha registro 10/05/2001	NIF A-85534667	NIF N-0012958E
Nº registro oficial 2378		
Categoría CNMV RF EURO		
NIF V-82899980		

Cartera

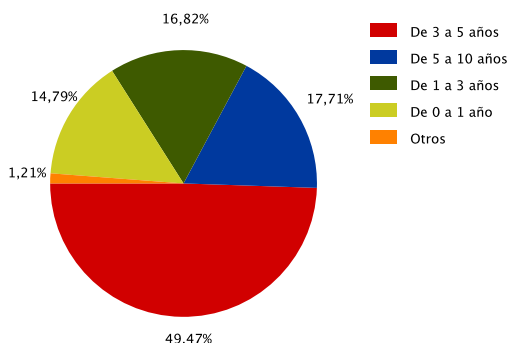
Top ten (31/10/2018)

Principales inversiones	Porcentaje
BO.BANKIA SA VAR 220519 VTO/C/24	3,96%
DEUDA ESTADO ITALIA 0,9% 010822	3,66%
BO.CRITERIA CAIXA 1,5% 100523	3,58%
BO.COMMUNITY OF MADRID 4,125% 210524	3,29%
BO.OBRIGACOES DO TESOUR FRN 051222	3,25%
BO.FORD MOTOR CREDIT CO FRN 071222	3,10%
BO.BBVA VAR 110419 VTO/C/24	2,77%
BO.BNP PARIBAS 2,375% 170225	2,49%
BO.INTESA SANPAOLO SPA FRN 150323	2,33%
DEUDA ESTADO ITALIA 1,35% 150422	2,33%

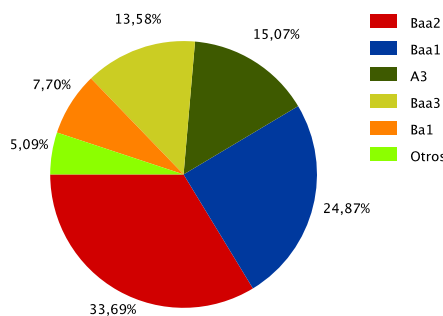
Distribución por tipo de activo (31/10/2018)



Distribución por duración (31/10/2018)



Distribución por rating: Renta fija (31/10/2018)



Aviso legal

Información suministrada por VDOS Stochastics S.L. (en adelante, [VDOS](#)) basándose en datos públicos obtenidos directamente de las Sociedades Gestoras de Instituciones de Inversión Colectiva, de las Entidades Gestoras de Fondos de Pensiones, de la CNMV, de la DGS y de procesos propios. En todo caso la información no debe usarse a efectos de realizar transacciones. Los datos contenidos son de carácter informativo. No se están facilitando ni valorando datos financieros ni inversores del público usuario y, por tanto, el servicio no comporta recomendación de asesoramiento sobre el producto más apropiado a sus objetivos ni incitación para la suscripción, reembolso, canje o traspaso de participaciones. Rentabilidades pasadas no son un indicador fidedigno de rentabilidades futuras.

La información no sustituye ni modifica la contenida en los folletos informativos, documentos de especificaciones, hechos relevantes, memoria, informes semestrales y trimestrales que siempre prevalecerán sobre ésta y que se encuentra disponible en el domicilio de la Sociedad Gestora y en los organismos oficiales competentes. [VDOS](#) no tendrá obligación o responsabilidad alguna por cualquier reclamación derivada del uso de la información presentada.