

**SANTALUCIA RENTA FIJA, FI A**

FICHA MENSUAL | Julio 2019

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

Rating VDOS **☆☆☆☆**  
 Rango de volatilidad **Menor o igual 2%**

**Características**

**Datos identificativos**

ISIN **ES0170138004**  
 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**

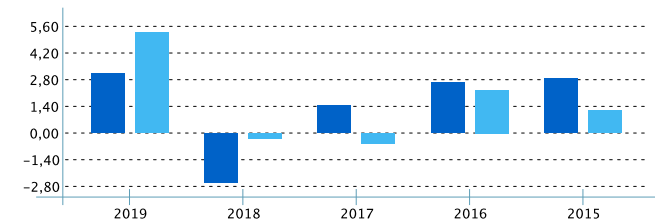
Aportación mínima **1.000.000,00 EUR**  
 Mínimo a mantener **1.000.000,00 EUR**  
 Referencia **Bloomberg/EFFAS Bond Indices TR Euro Govt 3-5 años (40%) + Iboxx Corporate TR 3-5 años (40%) + Iboxx Corporate TR EUR Liquid High Yield (15%) + Índice AFI de repo día sobre gobierno español (5%)**

**Rentabilidades**

**Anuales**

	2019	2018	2017	2016	2015
Fondo	3,12%	-2,59%	1,45%	2,64%	2,86%
Categoría	5,30%	-0,29%	-0,56%	2,26%	1,16%
Ranking	478/676	498/632	104/551	220/500	21/457
Quintil	4	4	1	3	1

Cálculos realizados en divisa EUR

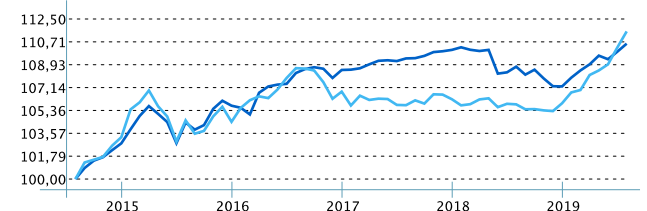


— SANTALUCIA RENTA FIJA, FI A  
 — RF EURO LARGO PLAZO

**Acumuladas**

	3 meses	6 meses	12 meses	3 años	5 años
Fondo	0,85%	2,46%	1,65%	2,12%	10,57%
Categoría	2,81%	4,46%	5,39%	2,64%	11,53%
Ranking	543/688	487/677	489/669	284/509	183/427
Quintil	4	4	4	3	3

Cálculos realizados en divisa EUR



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

Evolución histórica: Periodo: 31/07/2014 - 31/07/2019

**Última valoración**

Valor liquidativo **19,247595 EUR**  
 Patrimonio (Clase A) **199.319,41 (En miles de euros)**  
 Patrimonio del fondo **202.576,20 (En miles de euros)**  
 Partícipes (Clase A) **.**  
 Partícipes del fondo **.**  
 Fecha **31/07/2019**

**Análisis (a 3 años)**

**Rentabilidad/Riesgo**

Rentabilidad anualizada **0,77%**  
 Volatilidad **1,78%**

**Ratios CML**

Sharpe **0,69**  
 Información **0,02**  
 Tracking Error **1,86%**

**Ratios SML**

Treynor **2,59%**  
 Alfa **0,67%**  
 Beta **0,47**

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

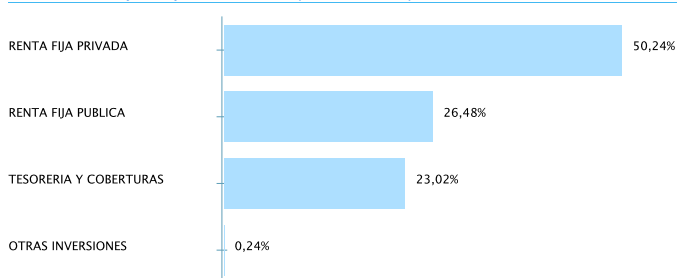
Fondo	Gestora	Depositaria
Ley 46/2002 Art. 40 A	SANTA LUCIA ASSET MANAGEMENT, SGIC, S.A.	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, SUCURSAL EN ESPAÑA
Fecha de constitución: 30/01/2001	Nº registro oficial: 225	Nº registro oficial: 206
Fecha registro: 10/05/2001	NIF: A-85534667	NIF: N-0012958E
Nº registro oficial: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

Cartera

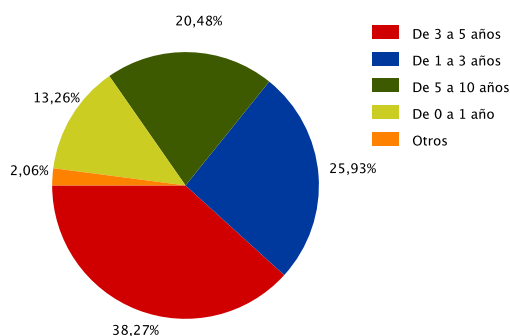
Top ten (31/07/2019)

Principales inversiones	Porcentaje
BO.BUONI POLIENNALI 2,1% 150726	4,61%
BO.CRITERIA CAIXA 1,5% 100523	3,87%
BO.COMMUNITY OF MADRID 4,125% 210524	3,44%
BO.PRINCIPADO DE ASTURIAS 0,037% 150422	2,97%
DEUDA ESTADO ITALIA 1,35% 150422	2,54%
BO.BANKIA SA 3,75% 150224 VTO/C/29	2,42%
BO.IE2 HOLDCO 2,375% 270823 VTO/C/23	2,39%
PAG ACCIONA 06/11/2019	2,21%
BO.BUONI POLIENNALI 1,75% 010724	2,06%
BO.OBRIGACOES DO TESOURO FRN 051222	2,02%

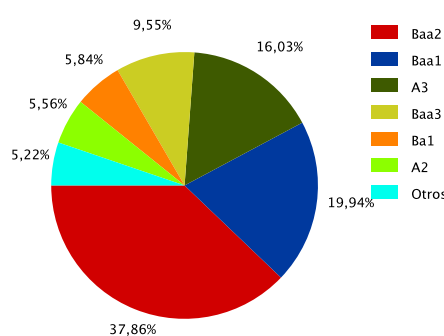
Distribución por tipo de activo (31/07/2019)



Distribución por duración (31/07/2019)



Distribución por rating: Renta fija (31/07/2019)



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.