

SANTALUCIA RETORNO ABSOLUTO, FI D

FICHA MENSUAL | Noviembre 2018

Gestora SANTALUCIA ASSET MANAGEMENT
Tipo VDOS RENTABILIDAD ABSOLUTA
Categoría VDOS ALTERNATIVOS. VOLAT.MEDIA

Rating VDOS 
Rango de volatilidad  Menor o igual 2%

Características

Datos identificativos

ISIN ES0112187010
Divisa EURO
Gestora SANTALUCIA ASSET MANAGEMENT
Grupo financiero SANTALUCIA
Depositaria BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, SUCURSAL EN ESPAÑA
Auditor PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES, S.L.

Comisiones

Fija 0,10%
Variable 0,00%
Depósito 0,03%
Suscripción 0,00%
Reembolso 0,00%

Política de inversión

El objetivo es una volatilidad inferior al 8% anual, que en las condiciones de mercado actuales, se corresponde con un objetivo de rentabilidad anual no garantizada de EURIBOR a 12 meses + 225 p.b.. Se invertirá entre 50% - 100% del patrimonio en IICs financieras que sean activo apto, armonizadas o no, del Grupo o no de la Gestora. Se invertirá directa o indirectamente, entre 0% - 100% de la exposición total en renta variable, renta fija pública y/o privada (incluyendo depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, líquidos), en bonos contingentes convertibles (se emiten normalmente a perpetuidad con opciones de recompra para el emisor y en caso de producirse la contingencia, pueden convertirse en acciones o aplicar una quita al principal del bono, afectando esto último negativamente al valor liquidativo del Fondo) y un máximo del 50% en bonos convertibles y/o canjeables por acciones y/o deuda subordinada.

Otras características

Aportación mínima 1.000,00 EUR
Mínimo a mantener 1,00 participaciones
Referencia EURIBOR a 12 meses + 225 p.b.

Rentabilidades

Anuales

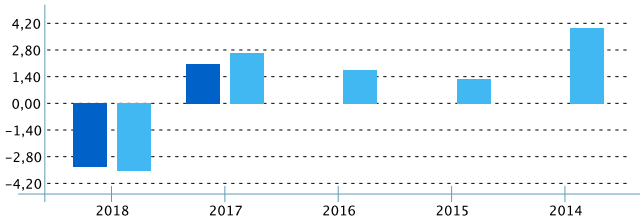
	2018	2017	2016	2015	2014
Fondo	-3,31%	2,06%	-	-	-
Categoría	-3,52%	2,66%	1,74%	1,26%	3,94%
Ranking	44/96	42/93	-	-	-
Quintil	3	3	-	-	-

Cálculos realizados en divisa EUR

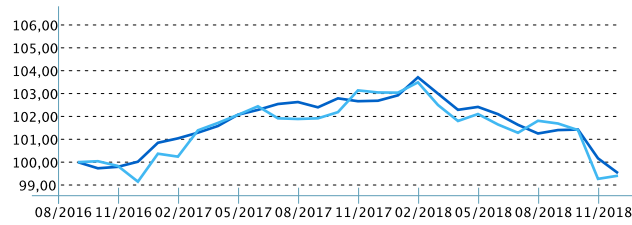
Acumuladas

	3 meses	6 meses	12 meses	3 años	5 años
Fondo	-1,86%	-2,53%	-3,08%	-	-
Categoría	-2,24%	-2,20%	-3,53%	-0,64%	6,01%
Ranking	50/105	51/102	40/96	-	-
Quintil	3	3	3	-	-

Cálculos realizados en divisa EUR



— SANTALUCIA RETORNO ABSOLUTO, FI D
— ALTERNATIVOS. VOLAT.MEDIA



Evolución histórica: Periodo: 31/08/2016 - 30/11/2018

Última valoración


Valor liquidativo 10,006363 EUR
Patrimonio (Clase D) 3.728,01 (En miles de euros)
Patrimonio del fondo 510.337,90 (En miles de euros)
Participes (Clase D) -
Participes del fondo -
Fecha 30/11/2018

Análisis (a 3 años)

Rentabilidad/Riesgo	Ratios CML	Ratios SML
Rentabilidad anualizada -	Sharpe -	Treynor -
Volatilidad -	Información -	Alfa -
	Tracking Error -	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:** ALTERNATIVOS. VOLAT.MEDIA. **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 04/02/2016	Nº registro oficial 225	Nº registro oficial 206
Fecha registro 01/07/2016	NIF A-85534667	NIF N-0012958E
Nº registro oficial 5028		
Categoría CNMV RETORNO ABSOLUTO		
NIF V-87543336		

Cartera

Top ten (31/10/2018)

Principales inversiones	Porcentaje
FI. EXANE-INTEGRAL-S	5,95%
FI. BLACKSTONE DIVERSIFIED MULTISTRATEGY	5,83%
FI. RAM LONG SHORT EUROPEAN EQUITIES	5,76%
FI. PION-ABSOLUTE RETURN MS-R?	5,72%
FI. BSF-FX IN S-I2?	5,70%
FI. CANDR-CR/OPP-I-C	3,92%
FI. AXA-GL ST B-IH?A	3,89%
FI. BNY-AB RT EQ-?UH	3,80%
FI. PICTET TR -DIVERSIFIED ALPHA -I?	3,78%
FI. GLG-ALP SL-IL-H?	2,94%

Distribución por tipo de activo (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.