

**SANTALUCIA RETORNO ABSOLUTO, FI A**

FICHA MENSUAL | Julio 2019

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

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

**Características**

**Datos identificativos**

**ISIN** ES0112187036  
**Divisa** EURO  
**Gestora** SANTALUCIA ASSET MANAGEMENT  
**Grupo financiero** SANTALUCIA  
**Depositaría** 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 de gestión del Fondo es obtener una rentabilidad positiva en cualquier entorno de mercado, sujeta a una volatilidad anual inferior al 5% anual. 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** 1.000.000,00 EUR  
**Mínimo a mantener** 1.000.000,00 EUR  
**Referencia** Sin Benchmark de Referencia

**Rentabilidades**

**Anuales**

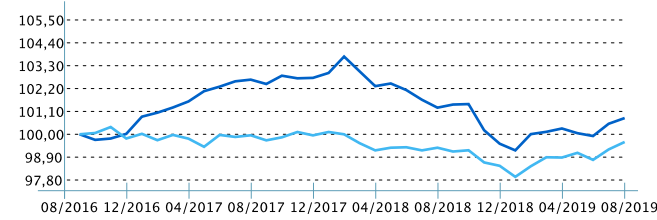
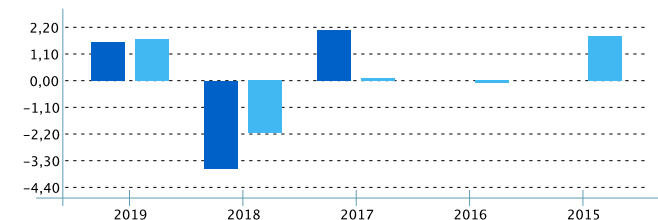
	2019	2018	2017	2016	2015
<b>Fondo</b>	1,57%	-3,62%	2,09%	-	-
<b>Categoría</b>	1,71%	-2,16%	0,09%	-0,09%	1,83%
<b>Ranking</b>	58/121	64/108	9/91	-	-
<b>Quintil</b>	3	3	1	-	-

Cálculos realizados en divisa EUR

**Acumuladas**

	3 meses	6 meses	12 meses	3 años	5 años
<b>Fondo</b>	0,73%	0,77%	-0,49%	-	-
<b>Categoría</b>	0,53%	1,19%	0,28%	-0,20%	3,10%
<b>Ranking</b>	44/124	63/122	56/117	-	-
<b>Quintil</b>	2	3	3	-	-

Cálculos realizados en divisa EUR



— SANTALUCIA RETORNO ABSOLUTO, FI A  
— ALTERNATIVOS. VOLAT.BAJA

Evolución histórica: Periodo: 31/08/2016 - 31/07/2019

**Última valoración**


**Valor liquidativo** 10,140020 EUR  
**Patrimonio (Clase A)** 424.355,04 (En miles de euros)  
**Patrimonio del fondo** 430.932,84 (En miles de euros)  
**Participes (Clase A)** -  
**Participes del fondo** -  
**Fecha** 31/07/2019

**Análisis (a 3 años)**

Rentabilidad/Riesgo	Ratios CML	Ratios SML
<b>Rentabilidad anualizada</b> -	<b>Sharpe</b> -	<b>Treynor</b> -
<b>Volatilidad</b> -	<b>Información</b> -	<b>Alfa</b> -
	<b>Tracking Error</b> -	<b>Beta</b> -

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.BAJA. **Divisa:** EUR.

**Datos del Registro Oficial**

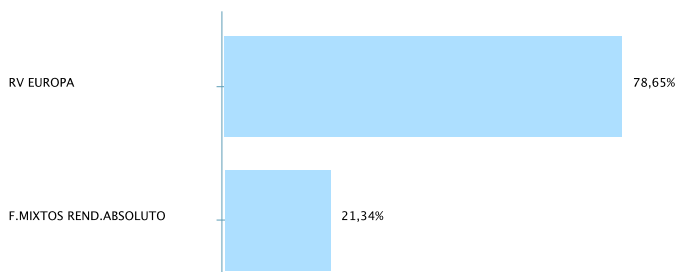
Fondo	Gestora	Depositaria
<b>Ley 46/2002 Art. 40 A</b>		
<b>Fecha de constitución</b> 	SANTA LUCIA ASSET MANAGEMENT, SGIIC, S.A.	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, SUCURSAL EN ESPAÑA
<b>Fecha registro</b>	<b>Nº registro oficial</b> 225	<b>Nº registro oficial</b> 206
<b>Nº registro oficial</b> 5028	<b>NIF</b> A-85534667	<b>NIF</b> N-0012958E
<b>Categoría CNMV</b> RETORNO ABSOLUTO		
<b>NIF</b> V-87543336		

**Cartera**

**Top ten (31/07/2019)**

Principales inversiones	Porcentaje
FI. BLACKSTONE DIVERSIFIED MULTISTRATEGY	7,06%
FI. EXANE-INTEGRAL-S	7,01%
FI. RAM LONG SHORT EUROPEAN EQUITIES	6,87%
FI. BSF-FX IN S-I2?	6,82%
FI. MLIS MARSHALL WACE TOPS UCITS	5,50%
FI.SANTALUCIA EURO BOLSA -A-	5,03%
FI. AXA-GL ST B-IH?A	4,84%
FI. CANDR-CR/OPP-I-C	4,73%
ETF PHYSICAL SWISS GOLD	4,68%
FI. GLG-ALP SL-IL-H?	4,54%

**Distribución por tipo de activo (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.