

Datos identificativos

ISIN	ES0112187036
Patrimonio del fondo	114.546.024 €
Fecha de lanzamiento	01/07/2016
Divisa	Euro
Inversión mínima	1.000.000 €
Rating Morningstar	★★
Fecha de Cartera	31/05/2021
Perfil de Riesgo CNMV (sobre 7)	3
VL Cierre de Mes	9,37 €
Política de dividendos	Acc
Gastos Corrientes	0,94%
Comisión de gestión	0,10%

Estrategia de inversión

Se invertirá entre 50% y 100% del patrimonio en IIC financieras que sean activo apto, armonizadas o no, del Grupo o no de la Gestora. Se invertirá directa o indirectamente, entre 0% y 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 (podrán comportarse como activos de renta variable) y/o deuda subordinada (con preferencia de cobro posterior a los acreedores comunes).

Comentario mensual del gestor

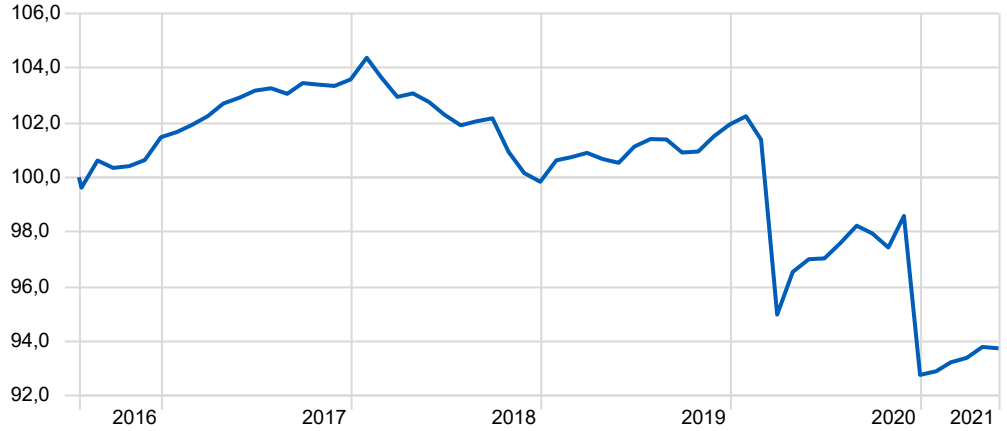
Mes de resultados ligeramente negativos para el fondo y con resultados mixtos para las estrategias. Los más favorecidos han sido los fondos mixtos, multiestrategia y global macro, DWS Kaldemorgen, Trojan Fund y Schroder Gaia Helix se acercaba al 0,5% de rentabilidad en el mes. Por la parte negativa, el conjunto de estrategias market neutral no restaba un 1% a lo largo de mayo. Con respecto a la estructura de Santalucía Retorno Absoluto, seguimos manteniendo una alta diversificación en estrategias líquidas englobadas en las 4 grandes categorías del retorno absoluto: Event Driven, Relative Value, Global Macro y Equity Hedge. A lo largo del último mes no se han realizado cambios sustanciales en la cartera.

Datos Gestora

Gestora	Santalucía Asset Management SGIIC
CIF	A-85534667
Depositario	BNP Paribas Securities Services (España) S.A.
Auditor	PricewaterhouseCoopers Auditores S.L.
Sitio Web	www.santaluciaam.es
Dirección	Plaza de España, 15 (Madrid)
Teléfono	(+34) 91 297 16 70

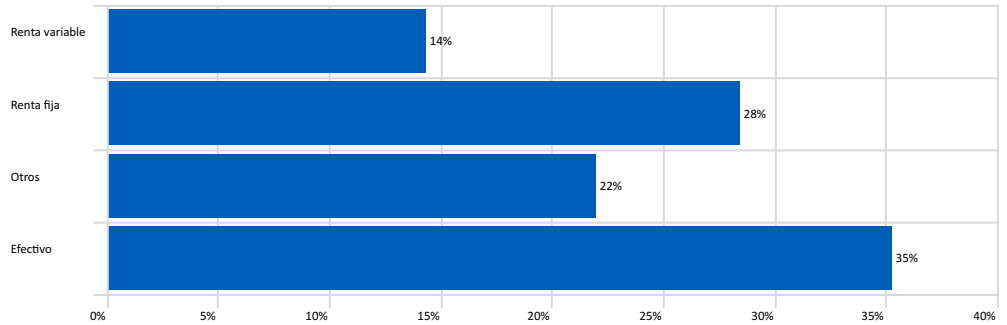
Fuente: Morningstar Direct

Evolución histórica



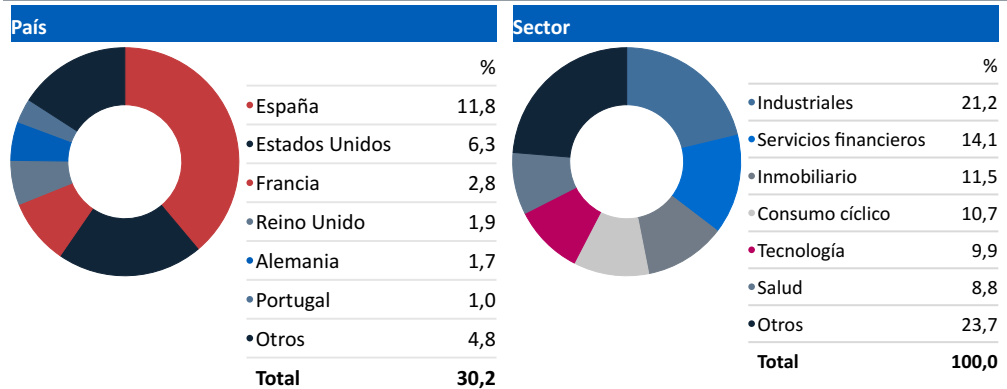
— Santalucía Retorno Absoluto A FI

Asignación activos

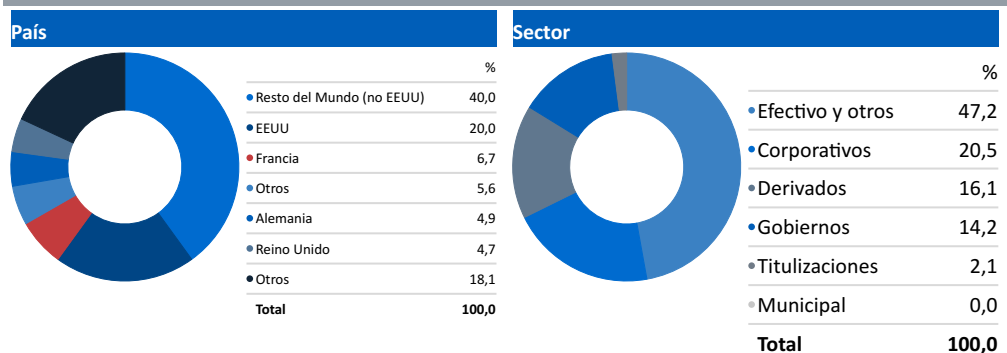


■ Santalucía Retorno Absoluto A FI

Renta Variable



Renta Fija

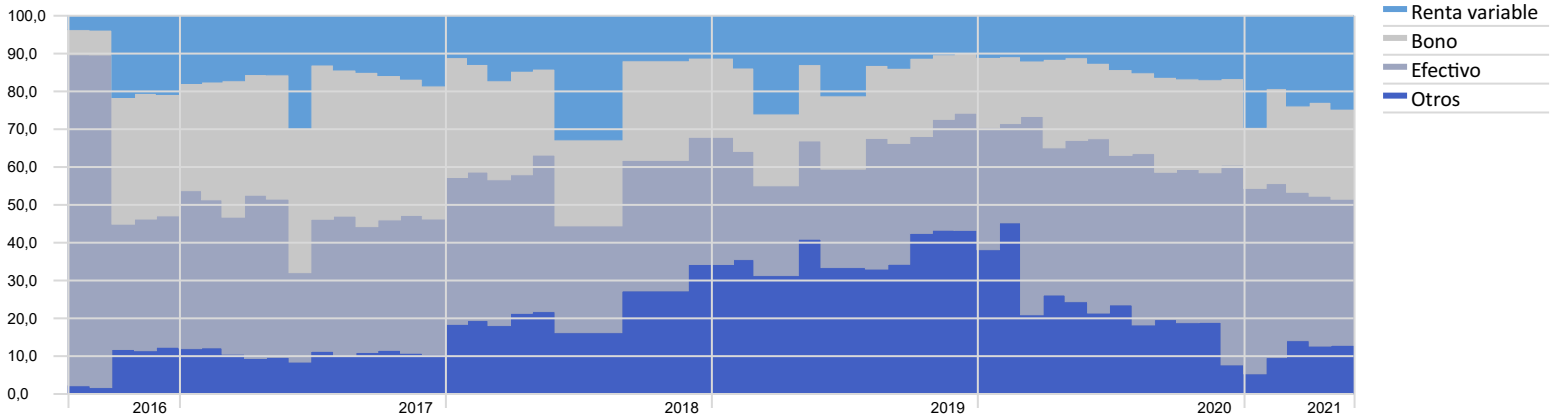


Rentabilidades mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2021	0,14%	0,35%	0,18%	0,43%	-0,05%								1,05%
2020	0,29%	-0,84%	-6,32%	1,65%	0,48%	0,03%	0,58%	0,64%	-0,29%	-0,53%	1,19%	-5,90%	-9,00%
2019	0,79%	0,11%	0,16%	-0,22%	-0,14%	0,59%	0,27%	-0,02%	-0,47%	0,04%	0,55%	0,44%	2,11%
2018	0,77%	-0,69%	-0,69%	0,13%	-0,31%	-0,46%	-0,37%	0,15%	0,10%	-1,20%	-0,77%	-0,32%	-3,62%
2017	0,19%	0,25%	0,32%	0,45%	0,21%	0,25%	0,08%	-0,20%	0,38%	-0,06%	-0,04%	0,23%	2,09%

Evolución exposición por tipo de activo

Periodo de tiempo: Desde creación a 31/05/2021



Rentabilidad anualizada

YTD 1 año 3 años 5 años 7 años 10 años

Santalucía Retorno Absoluto A FI 1,05% -3,36% -3,02%

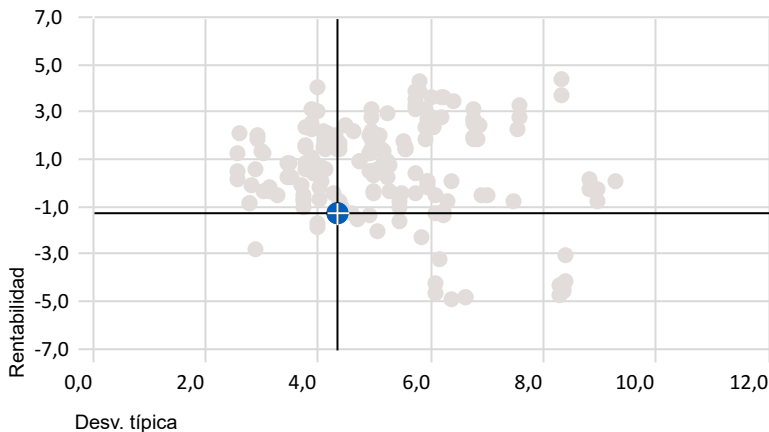
Riesgo

Volatilidad Alpha Beta R2 Sharpe Tracking Error

Santalucía Retorno Absoluto A FI 4,34% -0,13

Rentabilidad - Riesgo

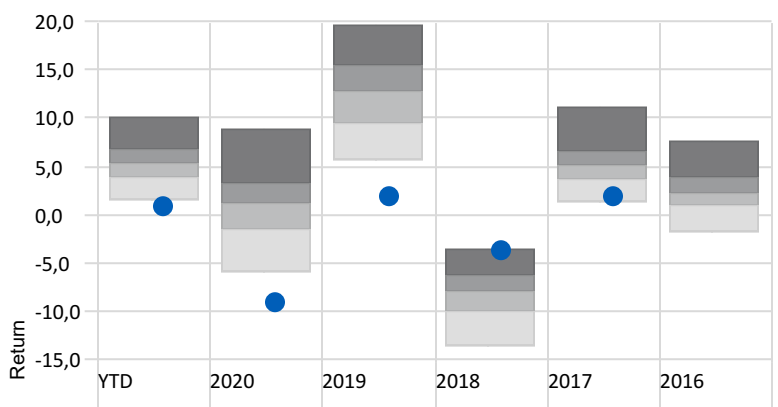
Peer Group (5-95%): Funds - Europe/Africa/Asia - Multistrategy EUR



● Santalucía Retorno Absoluto A FI

Rentabilidad vs. Benchmark

Cuartil superior 2do Cuartil 3er Cuartil Cuartil inferior



● Santalucía Retorno Absoluto A FI

Disclaimer

La información contenida en el presente documento ha sido suministrada por Morningstar, Inc. Se ofrece con carácter comercial y con fines exclusivamente informativos, y no constituye ninguna recomendación de inversión, asesoramiento personalizado u oferta. Asimismo, no se puede considerar un sustitutivo de los Datos Fundamentales del Inversor (DFI) o de cualquier otra información legal que deba ser consultada con carácter previo a cualquier decisión de inversión. Consulte el folleto informativo y demás documentación del fondo en la web de la Gestora www.santaluciaam.es y en la CNMV. Las rentabilidades pasadas no garantizan rentabilidades futuras. Santa Lucía Asset Management, SGIIC, SA no tendrá responsabilidad alguna por cualquier reclamación derivada del uso de la información facilitada...