

## Datos identificativos

ISIN	ES0112187036
Patrimonio del fondo	390.527.155 €
Fecha de lanzamiento	01/07/2016
Divisa	Euro
Inversión mínima	1.000.000 €
Rating Morningstar	
Rating Sostenibilidad Morningstar	
Fecha de Cartera	29/02/2020
Perfil de Riesgo CNMV (sobre 7)	3
VL Cierre de Mes	10,14 €
Política de dividendos	Acc
Gastos Corrientes	1,13%
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

En el mes de febrero las bolsas cierran su peor mes desde octubre de 2008. La rápida expansión del coronavirus Covid-19 ha aumentado el miedo a una recesión mundial, castigando fuertemente a todos los mercados financieros. Destacan entre los sectores más afectados el sector industrial por la falta de suministro y el de servicios por el turismo y la hostelería como mayores perjudicados por esta situación.

Abultadas caídas en las principales bolsas mundiales: El Eurostoxx 50 con dividendos cayó un 8,43%, el Ibex 35 con dividendos un 6,88%, el S&P 500 un 8,41%, el Nikkei 225 un 8,82%. El índice de materias primas Bloomberg Commodity un 5,15% con el petróleo medido con el West Texas cerrando en 44,76 USD por barril, y el oro en 1585,69 USD la onza.

Las mayores posiciones del fondo son: Exane Integrale con un 7,52% de exposición, Blackstone Diversified Multistrategy que pesa en la cartera un 7,36% y Axa Strategic Bonds que representa un 5,15% en el fondo.

## Datos identificativos

Gestora	Santalucía Asset Management SGILIC
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

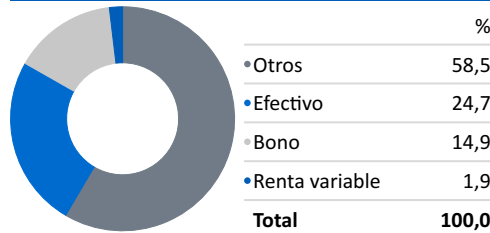
Fuente: Morningstar Direct

## Evolución histórica

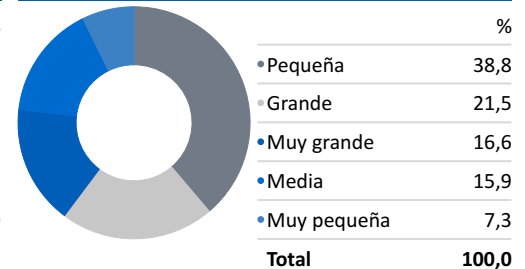


— Santalucía Retorno Absoluto A FI

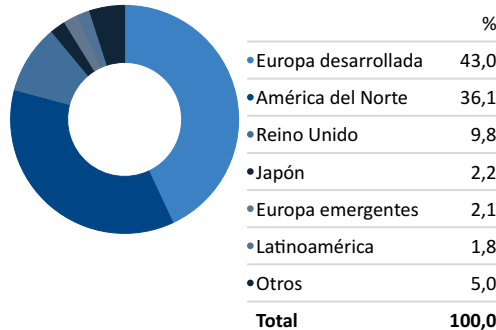
## Activo



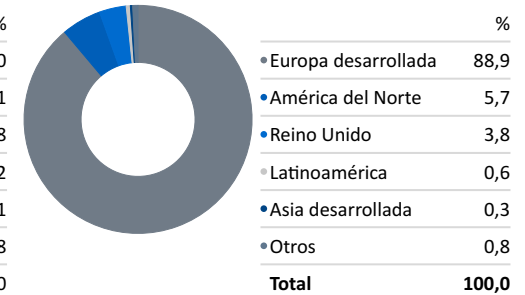
## Capitalización



## RF Distribución Geográfica



## RV Distribución Geográfica



## Santalucía Retorno Absoluto A FI - Tenencias más altas

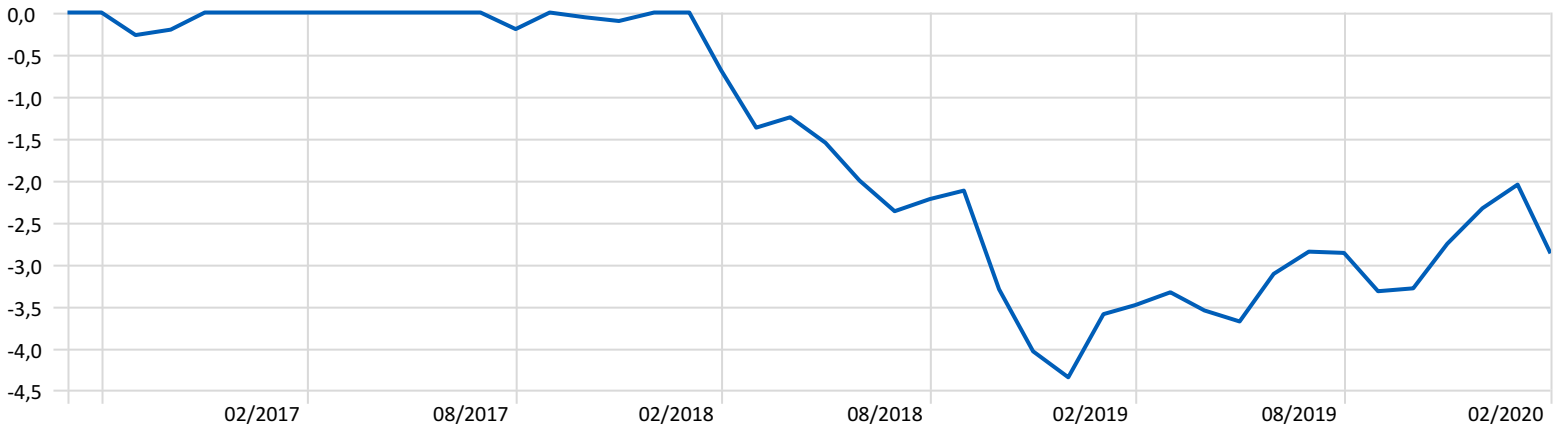
Fecha de la posición en cartera: 29/02/2020

	Peso	% YTD	Morningstar Category
Exane Funds 1 Exane Integrale S EUR	8,56%	-27,61%	EAA Fund Alt - Multistrategy
Blackstone Divrsifd Multi-Stgy I EUR Acc	8,37%	-8,92%	EAA Fund Alt - Multistrategy
AXAWF Global Strategic Bds I Cap EUR H	5,87%	-1,59%	EAA Fund Global Flexible Bond - EUR Hedged
BSF Fixed Income Strategies I2 EUR	5,65%	-6,94%	EAA Fund Alt - Long/Short Credit
Candriam Bds Crdt Opps I EUR Cap	5,65%	-5,17%	EAA Fund Alt - Long/Short Credit
Santalucía Eurobolsa A FI	5,64%	-36,69%	EAA Fund Eurozone Flex-Cap Equity
Schroder GAIA Helix E EUR Hedged Acc	5,56%	-2,80%	EAA Fund Alt - Multistrategy
Man GLG Alpha Select Alt ILH EUR Acc	5,55%	2,09%	EAA Fund Alt - Market Neutral - Equity
Mercer Absolute Rt Fxd Inc A8-H-0.1700€	5,50%	-5,60%	EAA Fund Alt - Long/Short Credit
Lumyna Ramius Merger Arb EUR B Acc	5,42%	-17,89%	EAA Fund Alt - Event Driven

## Rentabilidades mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2020	0,29%	-0,84%											-0,55%
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%
2016								1,00%	-0,27%	0,07%	0,22%	0,83%	

## Máxima pérdida



— Santalucía Retorno Absoluto A FI

## Rentabilidad anualizada

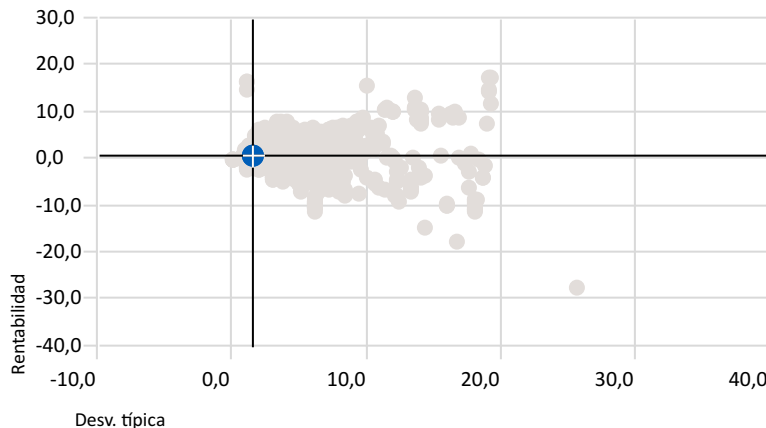
	YTD	1 año	3 años	5 años	7 años
Santalucía Retorno Absoluto A FI	-0,55%	0,64%	-0,17%		

## Riesgo

	Volatilidad	Alpha	Beta	R2	Ratio de Sharpe	Tracking Error
Santalucía Retorno Absoluto A FI	1,63%	-3,70	0,30	26,06	-0,96	10,03

## Rentabilidad - Riesgo

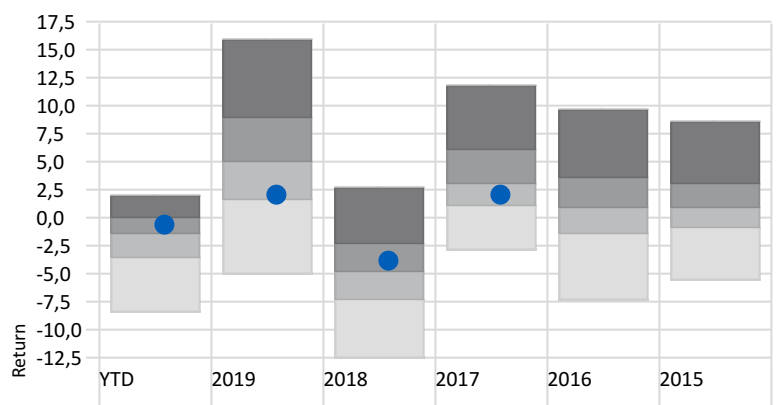
Peer Group (1-100%): Open End Funds - Europe/Africa/Asia - Alt - Multistrategy



● 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](http://www.santaluciaam.es) y en la CNMV. Las rentabilidades pasadas no garantizan rentabilidades futuras. Santa Lucía Asset Management, SGIC, SA no tendrá responsabilidad alguna por cualquier reclamación derivada del uso de la información facilitada.