

## Datos identificativos

ISIN	ES0170156006
Patrimonio del fondo	200.949.089 €
Fecha de lanzamiento	27/04/2010
Divisa	Euro
Inversión mínima	2.500.000 €
Rating Morningstar	★★★★
Fecha de Cartera	29/02/2020
Perfil de Riesgo CNMV (sobre 7)	1
VL Cierre de Mes	14,34 €
Política de dividendos	Acc
Gastos Corrientes	0,10%
Comisión de gestión	0,06%

## Estrategia de inversión

La gestión toma como referencia la rentabilidad del índice 20% índice AFI Letras a 1 año y 80% EONIA capitalizado a 7 días. 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 españoles y en menor medida de la zona euro y otros países OCDE, pudiendo invertir puntualmente hasta un 10% de la exposición total en emisores/mercados emergentes.

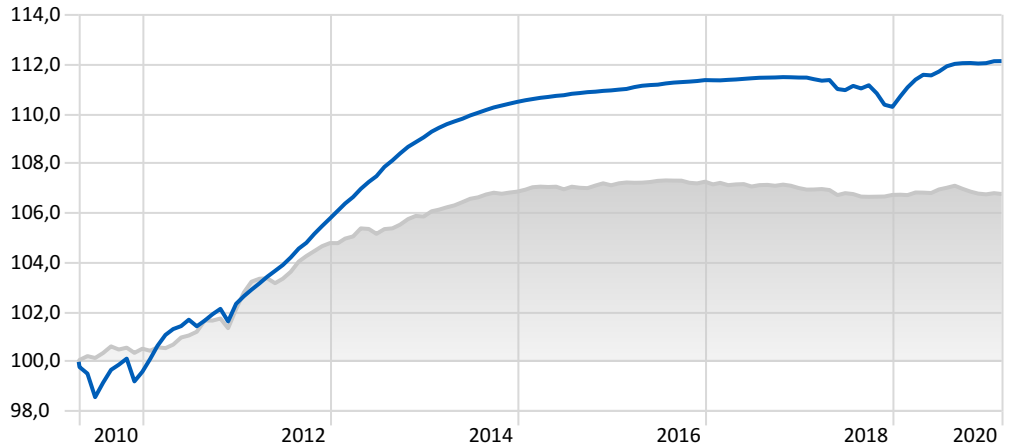
## Comentario mensual del gestor

Los mercados han estado dominados por una mayor volatilidad, debido principalmente a la evolución de la epidemia de coronavirus, que se ha comenzado a extender desde China a otros países, incrementando la incertidumbre sobre sus consecuencias en el crecimiento global. Esto se ha traducido en una huida hacia activos refugio, provocando una ampliación en los diferenciales de crédito y en las primas de riesgo de países periféricos, siendo Italia el mayor afectado dentro de Europa, debido al número significativo de casos de infección por coronavirus. Todo ello ha llevado al Bund alemán a una rentabilidad del -0,61%, y a las primas de riesgo de España e Italia a 89 y 171 puntos básicos, respectivamente. En el mes de Marzo se reúnen los principales bancos centrales, y se esperan medidas de estímulo adicionales en función de la evolución de la epidemia y su efecto en los mercados. En este contexto, la rentabilidad del Fondo ha sido ligeramente positiva en el mes (+0.003%). El fondo ha mantenido su duración en el entorno del 0.70, y seguimos ampliando la diversificación de emisores en periferia y en el sector financiero y corporativo.

## Datos Gestora

Gestora	Santalucía Asset Management SGIC
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

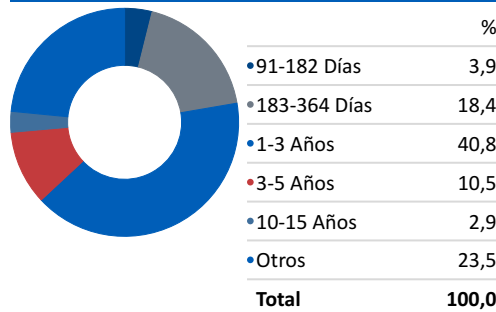
## Evolución histórica



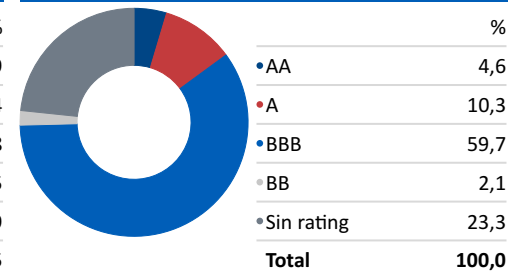
— Santalucía Renta Fija 0-2 A FI

■ 50% Barc. EUR Agg. 1-3 + 50% repo 1D

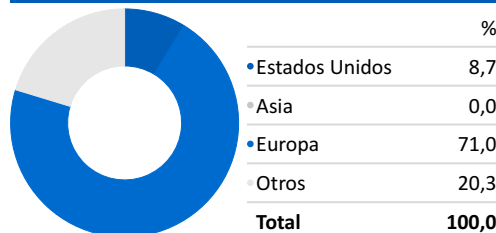
## Vencimiento



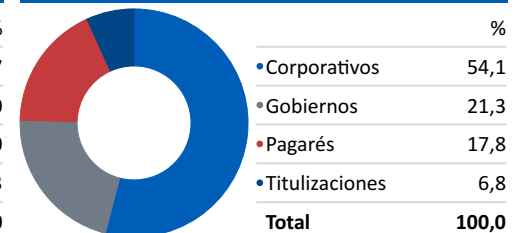
## Calidad crediticia



## País



## Sector



## Principales posiciones

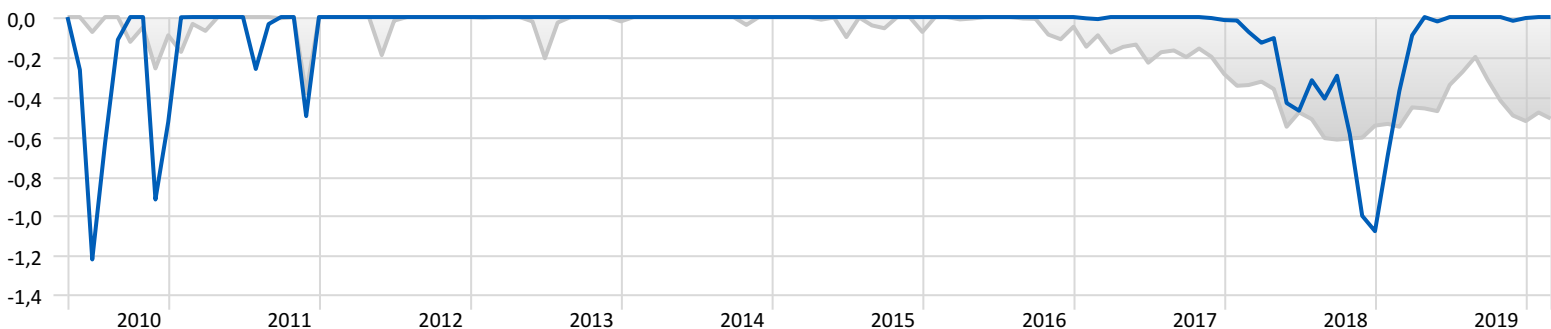
Fecha de la posición en cartera: 29/02/2020

Posición	Peso	Vencimiento	País
Deutsche Bank AG 0%	5,93%	07/12/2020	DEU
Future on 2 Year Treasury Note Future Sept 20	5,30%		
Italy (Republic Of) 686.74%	5,09%	15/01/2023	ITA
Intesa Sanpaolo S.p.A. 0%	3,61%	12/12/2020	ITA
Wells Fargo & Company 0%	3,09%	31/01/2022	USA
UBI Banca Spca 0%	3,07%	11/09/2021	ITA
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A. 0%	2,68%	09/03/2023	ESP
Portugal (Republic Of) 0%	2,67%	02/08/2022	PRT
Petroleos Mexicanos 0%	2,25%	27/11/2020	MEX
Asturias (Principado de) 217.35%	2,20%	15/04/2022	ESP

## Rentabilidades mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2020	0,07%	0,00%											
2019	0,39%	0,32%	0,28%	0,18%	-0,02%	0,14%	0,19%	0,09%	0,03%	0,01%	-0,02%	0,01%	1,60%
2018	0,00%	-0,06%	-0,05%	0,02%	-0,33%	-0,04%	0,15%	-0,09%	0,12%	-0,29%	-0,41%	-0,08%	-1,06%
2017	-0,01%	0,00%	0,02%	0,01%	0,02%	0,02%	0,02%	0,01%	0,01%	0,01%	-0,01%	-0,01%	0,09%
2016	0,03%	0,02%	0,07%	0,05%	0,02%	0,01%	0,04%	0,03%	0,02%	0,02%	0,02%	0,03%	0,38%

## Máxima pérdida



— Santalucía Renta Fija 0-2 A FI

— 50% Barc. EUR Agg. 1-3 + 50% repo 1D

## Rentabilidad anualizada

	YTD	1 año	3 años	5 años	7 años	10 años
Santalucía Renta Fija 0-2 A FI	0,07%	0,95%	0,23%	0,28%	0,75%	

## Riesgo

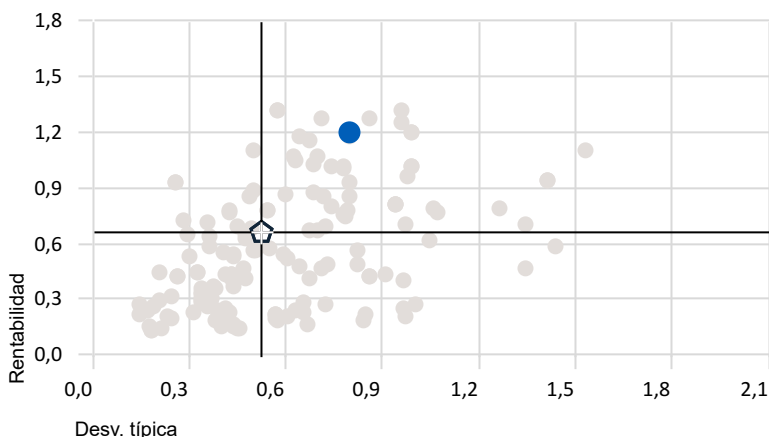
	Volatilidad	Alpha	Beta	R2	Sharpe	TE
Santalucía Renta Fija 0-2 A FI	0,80%	0,58	1,02	99,51	-1,76	0,69

	YTD	1 año	3 años	5 años	7 años	10 años
50% Barc. EUR Agg. 1-3 + 50% repo 1D	0,01%	0,04%	-0,14%	-0,05%	0,24%	0,66%

	Volatilidad	Alpha	Beta	R2	Sharpe	TE
50% Barc. EUR Agg. 1-3 + 50% repo 1D	0,52%	0,00	1,00	100,00	-3,69	0,00

## Rentabilidad - Riesgo

Peer Group (5-95%): Open End Funds - Europe/Africa/Asia - EUR Ultra Short-Term Bond

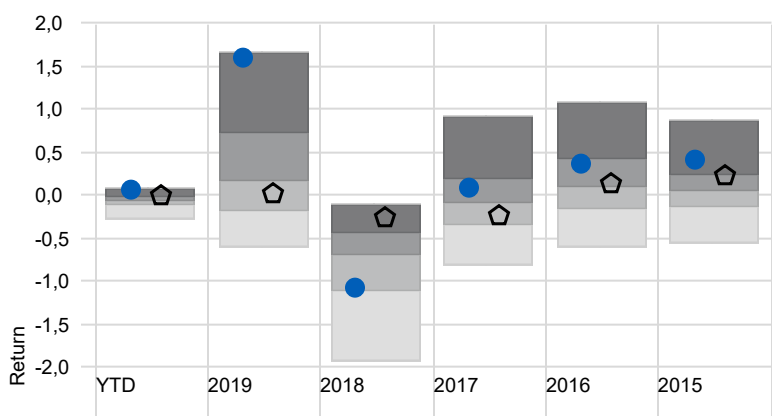


● Santalucía Renta Fija 0-2 A FI

● 50% Barc. EUR Agg. 1-3 + 50% repo 1D

## Rentabilidad vs. Benchmark

■ Cuartil superior ■ 2do Cuartil ■ 3er Cuartil ■ Cuartil inferior



● Santalucía Renta Fija 0-2 A FI

● 50% Barc. EUR Agg. 1-3 + 50% repo 1D

### 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.