

Datos identificativos

ISIN	ES0108686009
Patrimonio del fondo	2.838.700 €
Fecha de lanzamiento	23/01/2009
Divisa	Euro
Inversión mínima	1 €
Rating Morningstar	★★★★
Fecha de Cartera	31/01/2023
Perfil de Riesgo CNMV (sobre 7)	3
VL Cierre de Mes	12,83 €
Política de dividendos	Acc
Gastos Corrientes	0,62%
Comisión de gestión	0,50%

Estrategia de inversión

La gestión toma como referencia el comportamiento del índice EFFA, 3-5 años. Se invertirá el 100% de la exposición total en renta fija (incluyendo depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, líquidos) de emisores públicos o privados, en concreto Letras del Tesoro, Pagarés de Empresa o bonos y Adquisición temporal de activos de Deuda Pública. Los emisores/mercados serán principalmente pertenecientes a la OCDE, pudiendo invertir un máximo del 10% de la exposición total en emisores/mercados emergentes.

Comentario mensual del gestor

El fondo continúa con una posición prudente y con un colchón suficiente de liquidez. Mantenemos la sobreponderación en crédito, particularmente en el sector financiero y en covered bonds. En los próximos meses, esperamos que continúe la volatilidad en los tipos de interés a medio y largo plazo con tendencia a subidas, en función sobre todo de la evolución de la inflación. La TIR media de la cartera se sitúa en el 4,40%, lo que ofrece un atractivo valor relativo con respecto a los tipos de interés libres de riesgo a largo plazo, medido por el plazo a 10 años del Gobierno alemán, que cierra el mes en 1,93%. La duración se mantiene en torno a 3 años. Pensamos que la rentabilidad esperada de la cartera sigue siendo muy atractiva en este contexto de alta volatilidad.

Datos gestora

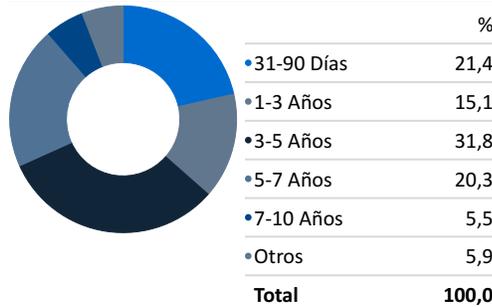
Gestora	Santalucía Asset Management SGIIC
CIF	A-85534667
Depositario	BNP Paribas Securities Services (España) S.A.
Auditor	PricewaterhouseCoopers Auditores S.L.
Sitio web	www.santaluciaam.es
Dirección	Plaza de España, 15 (Madrid)
Teléfono	(+34) 91 297 16 70

Evolución histórica

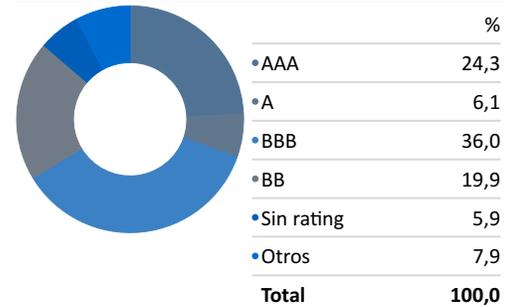


— Santalucía Renta Fija Dinámica C FI

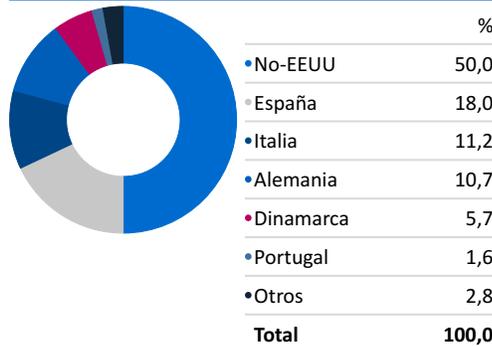
Vencimiento



Calidad crediticia



País



Sector



Principales posiciones

Fecha de la posición en cartera: 31/01/2023

	Peso	Vencimiento	País
Euro Bobl Future Mar 23	19,65%	08/03/2023	DEU
Italy (Republic Of) 0%	10,98%	01/07/2024	ITA
Italy (Republic Of) 0%	6,28%	01/04/2026	ITA
Spain (Kingdom of) 113.97%	5,12%	30/07/2027	ESP
Banco Santander, S.A. 0%	2,83%	11/05/2024	ESP
Banco de Sabadell SA 0%	2,81%	12/12/2023	ESP
Kutxabank SA 0%	2,80%	01/02/2027	ESP
Italy (Republic Of) 0%	2,74%	14/09/2023	ITA
Danske Bank A/S 0%	2,64%	12/02/2025	DNK
Ald S.A. 0%	2,63%	02/03/2026	FRA

Rentabilidades mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2023	2,41%												2,41%
2022	-0,59%	-1,68%	-0,60%	-1,88%	-0,73%	-3,23%	1,60%	-2,08%	-2,80%	0,37%	1,93%	-0,97%	-10,26%
2021	-0,07%	-0,04%	0,67%	0,16%	-0,15%	0,22%	0,20%	0,00%	-0,12%	-0,51%	-0,09%	0,09%	0,37%
2020	0,73%	-0,99%	-7,06%	2,38%	0,86%	1,09%	1,00%	0,80%	0,14%	0,14%	1,97%	0,25%	0,97%
2019	0,77%	0,73%	0,37%	0,82%	-0,61%	0,72%	0,94%	0,87%	0,28%	0,25%	-0,35%	0,32%	5,23%

Máxima pérdida



— Santalucía Renta Fija Dinámica C FI

Rentabilidad anualizada

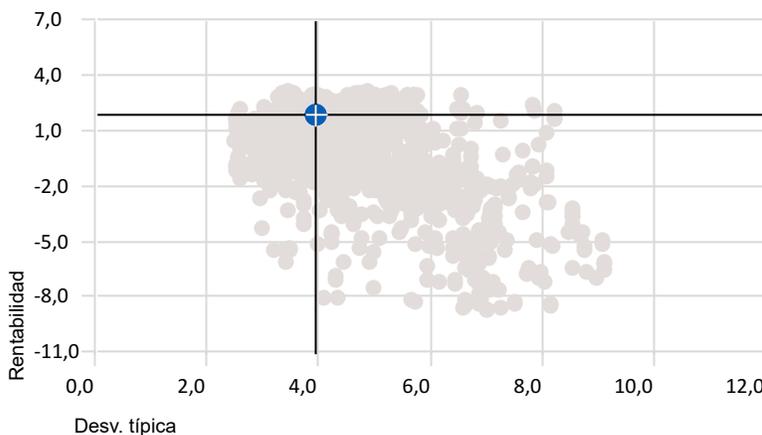
	YTD	1 año	3 años	5 años	7 años	10 años
Santalucía Renta Fija Dinámica C FI	2,41%	-7,56%	-2,58%	-1,15%	0,44%	1,06%

Riesgo

	Volatilidad	Alpha	Beta	R2	Sharpe	TE
Santalucía Renta Fija Dinámica C FI	3,94%	-0,49	1,00	85,18	-0,01	4,10

Rentabilidad - Riesgo

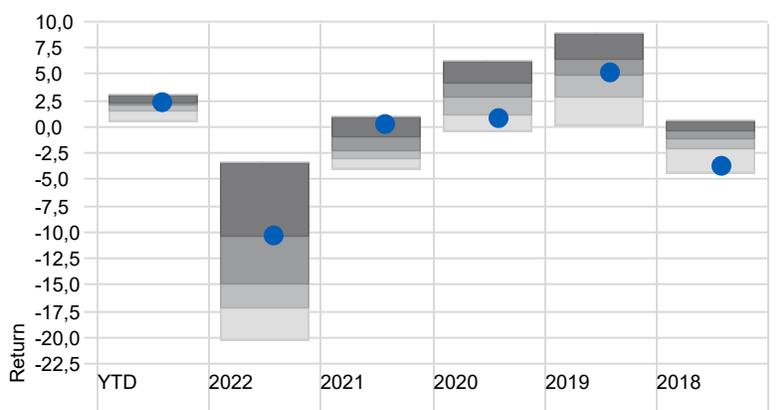
Peer Group (5-95%): Funds - Europe/Africa/Asia - EUR Diversified Bond



● Santalucía Renta Fija Dinámica C FI

Rentabilidad vs. Benchmark

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



● Santalucía Renta Fija Dinámica C 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, SGIC, SA no tendrá responsabilidad alguna por cualquier reclamación derivada del uso de la información facilitada.