

Datos identificativos

ISIN	ES0112187010
Patrimonio del fondo	15.406.569 €
Fecha de lanzamiento	01/07/2016
Divisa	Euro
Inversión mínima	1.000 €
Rating Morningstar	★
Rating Sostenibilidad Morningstar	🌱🌱🌱🌱
Fecha de Cartera	31/03/2025
Nivel de Riesgo CNMV (sobre 7)	2
VL Cierre de Mes	9,41 €
Política de dividendos	Acc
Gastos Corrientes	1,16%
Comisión de gestión	0,45%

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 y/o deuda subordinada (con preferencia de cobro posterior a los acreedores comunes).

Comentario mensual del gestor

La estructura del fondo está compuesta por estrategias líquidas poco correlacionadas englobadas en las 4 grandes categorías del retorno absoluto (event driven, relative value, global macro y equity hedge) y una parte genérica de réplica de hedge funds. Por posicionamiento, seguimos sobreponderando la categoría de equity hedge. Hemos incorporado una estrategia de Cat bonds debido al nivel actual de las yields en el activo.

Datos gestora

Gestora	Santalucía Asset Management SGIC
CIF	A-85534667
Depositario	Cecabank, S.A.
Auditor	Ersnt & Young
Sitio web	www.santaluciaam.es
Dirección	Plaza de España, 15 (Madrid)
Teléfono	(+34) 91 297 16 70

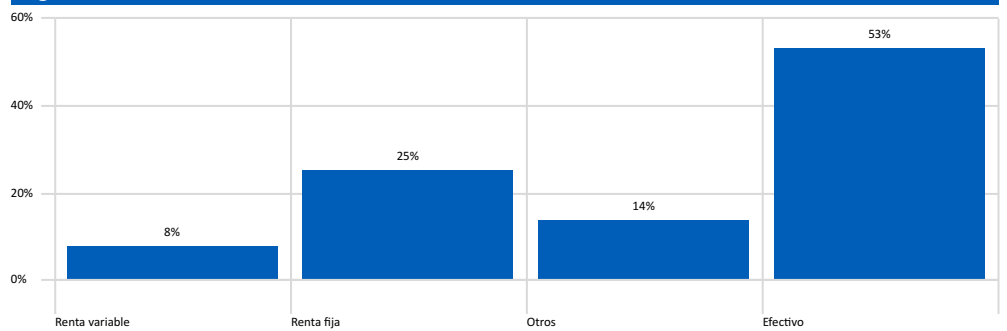
Fuente: Morningstar Direct

Evolución histórica



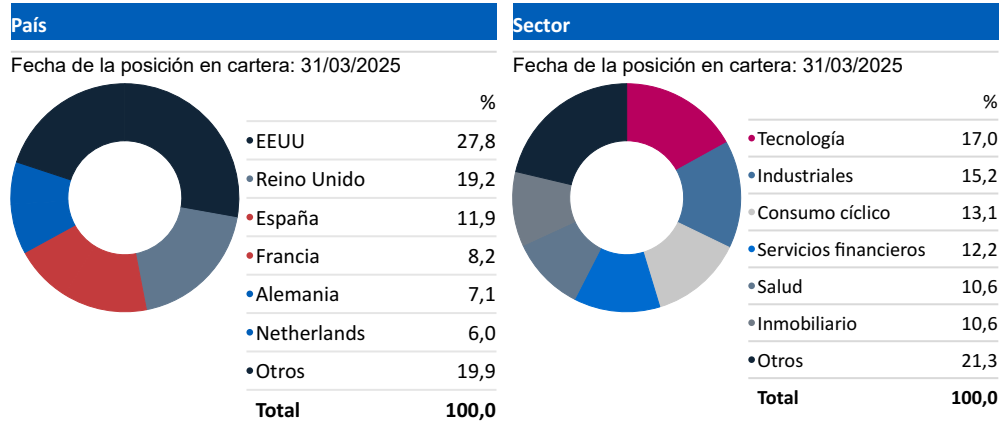
— Santalucía Retorno Absoluto C FI

Asignación activos

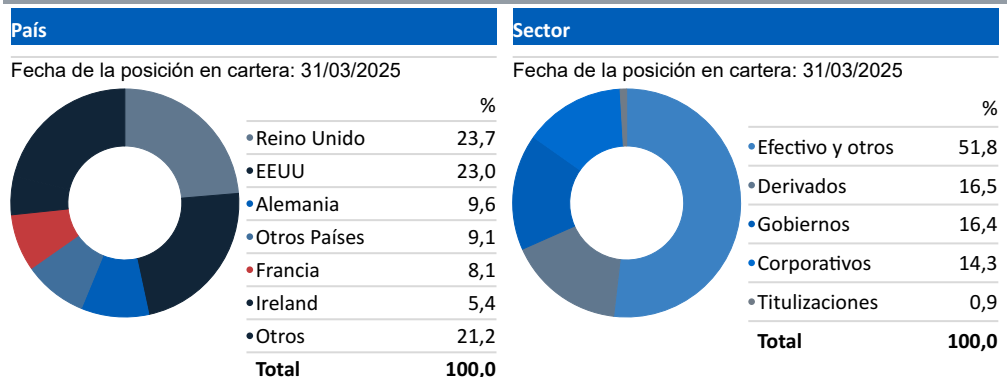


■ Santalucía Retorno Absoluto C FI

Renta Variable



Renta Fija

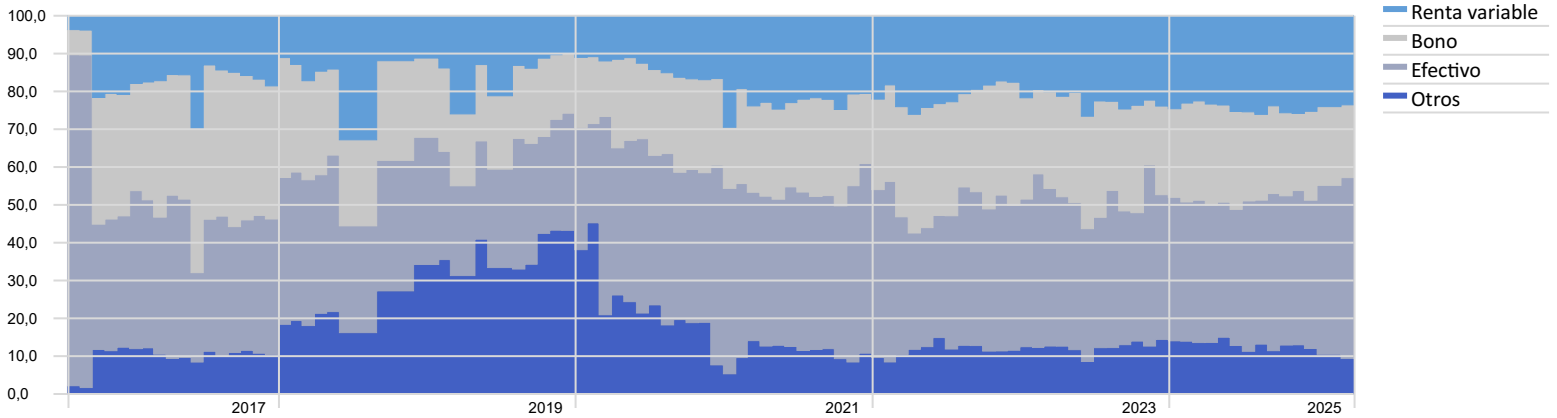


Rentabilidades mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2025	0,90%	-0,50%	-0,95%										-0,56%
2024	0,14%	0,44%	0,42%	0,01%	0,27%	0,65%	-0,11%	-0,01%	-0,04%	-0,11%	0,76%	0,13%	2,57%
2023	0,47%	-0,26%	0,02%	0,21%	-0,10%	0,13%	0,27%	0,39%	-0,12%	-0,10%	0,80%	0,96%	2,71%
2022	-1,09%	-0,56%	0,20%	-0,77%	-0,85%	-0,70%	0,50%	-0,19%	-1,17%	-0,15%	0,29%	0,39%	-4,05%
2021	0,12%	0,33%	0,15%	0,40%	-0,08%	0,34%	0,13%	0,13%	-0,27%	-0,01%	-0,03%	0,47%	1,68%

Evolución exposición por tipo de activo

Periodo de tiempo: Desde creación a 31/03/2025



Rentabilidad anualizada

YTD 1 año 3 años 5 años 7 años 10 años

Santalucía Retorno Absoluto C FI -0,56% 0,99% 0,66% -0,09% -1,26%

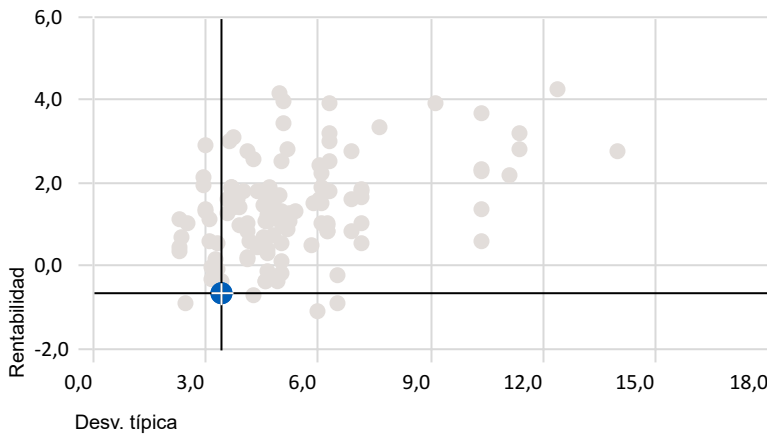
Riesgo

Volatilidad Alpha Beta R2 Sharpe Tracking Error

Santalucía Retorno Absoluto C FI 3,44% -0,96

Rentabilidad - Riesgo

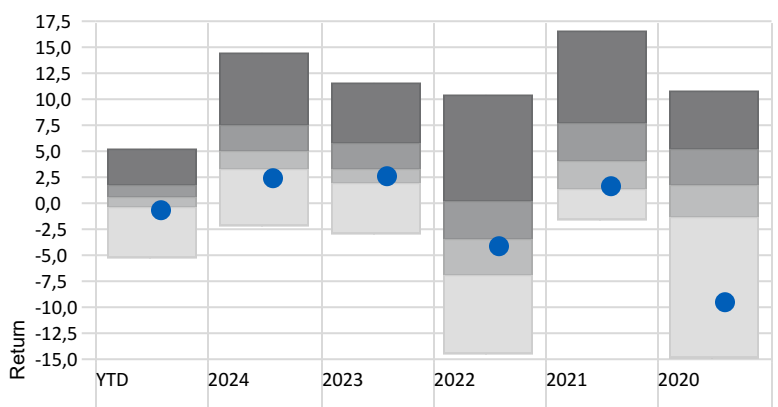
Peer Group (5-95%): Funds - Europe/Africa/Asia - Multistrategy EUR



● Santalucía Retorno Absoluto C FI

Rentabilidad vs. Benchmark

Cuartil superior 2do Cuartil 3er Cuartil Cuartil inferior



● Santalucía Retorno Absoluto 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, SGIIC, SA no tendrá responsabilidad alguna por cualquier reclamación derivada del uso de la información facilitada...