Santalucía Retorno Absoluto C FI

Datos identificativos

ISIN	ES0112187010
Patrimonio del fondo	15.300.362 €
Fecha de lanzamiento	01/07/2016
Divisa	Euro
Inversión mínima	1.000 €
Rating Morningstar	★
Rating Sostenibilidad Morningstar	
Fecha de Cartera	30/06/2025
Nivel de Riesgo CNMV (sobre 7)	2
VL Cierre de Mes	9,42 €
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. Tenemos además una estrategia de Cat Bonds y otra de senior ABS debido a su atractivo nivel de carry. Durante el mes hemos añadido una estrategia de relative value de crédito (Candriam Credit Alpha).

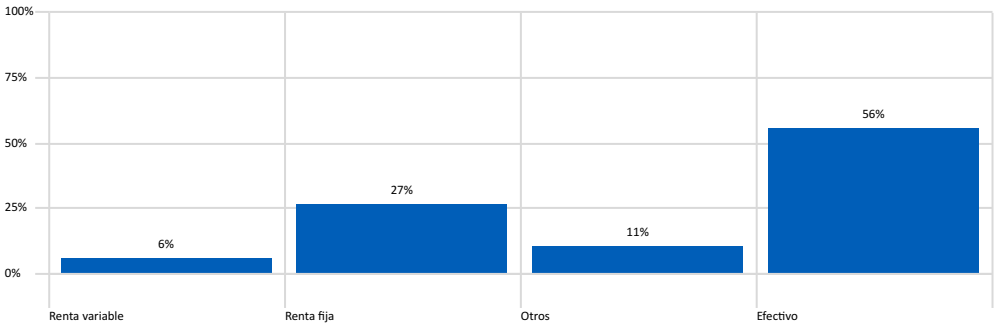
Datos gestora

Gestora	Santalucía Asset Management SGIIC
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

Evolución histórica

Santalucía Retorno Absoluto C FI

Asignación activos



Santalucía Retorno Absoluto C FI

Renta Variable

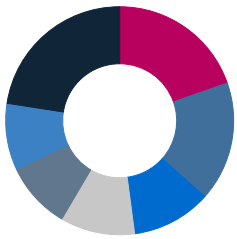
País

Fecha de la posición en cartera: 30/06/2025

	%
EEUU	28,9
Reino Unido	17,7
España	10,5
Alemania	9,1
Francia	8,8
Netherlands	8,3
Otros	16,8
Total	**100,0**

Sector

Fecha de la posición en cartera: 30/06/2025



	%
Tecnología	19,6
Industriales	17,0
Servicios financieros	11,3
Consumo cíclico	10,6
Salud	9,5
Consumer Defensive	9,4
Otros	22,5
Total	**100,0**

Renta Fija

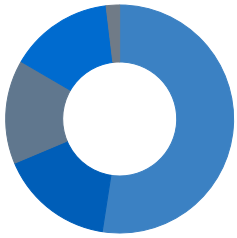
País

Fecha de la posición en cartera: 30/06/2025

	%
EEUU	19,0
Reino Unido	18,2
Alemania	12,5
Francia	10,7
Otros Países	7,6
España	6,6
Otros	25,4
Total	**100,0**

Sector

Fecha de la posición en cartera: 30/06/2025



	%
Efectivo y otros	52,5
Gobiernos	16,2
Derivados	14,7
Corporativos	14,7
Titulizaciones	1,9
Total	**100,0**

Fuente: Morningstar Direct

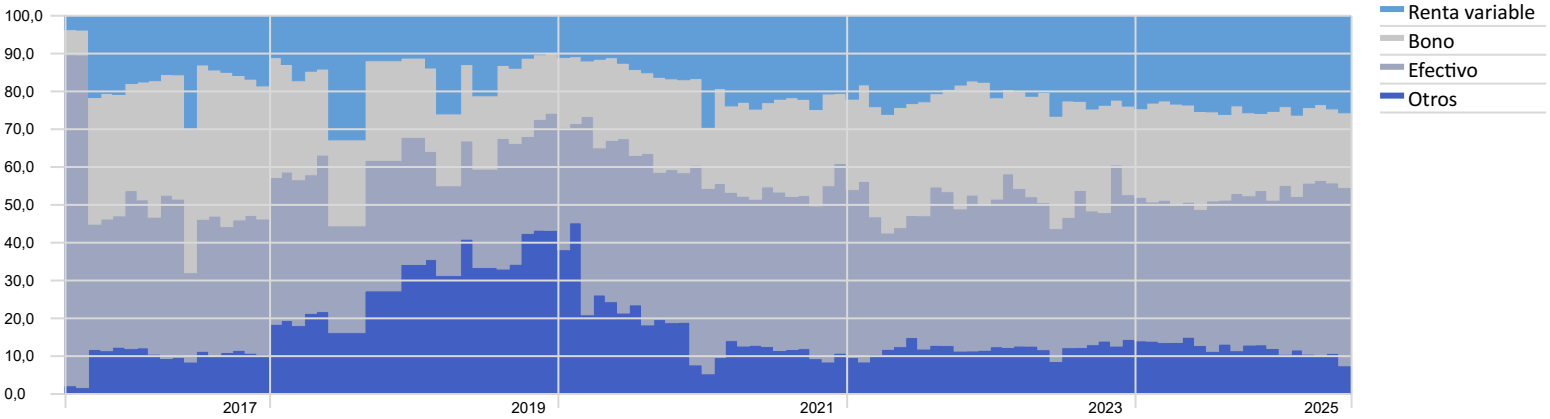
Santalucía Retorno Absoluto C FI

Rentabilidades mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2025	0,90%	-0,50%	-0,95%	-0,01%	0,23%	-0,06%	-0,03%						-0,44%
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 30/06/2025



Rentabilidad anualizada

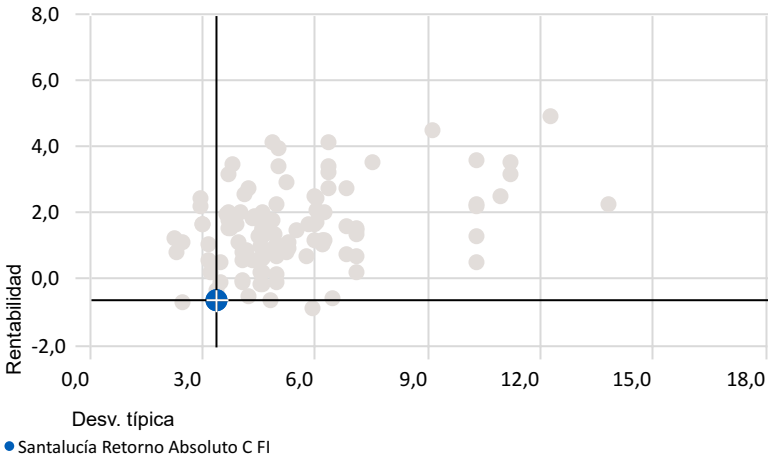
	YTD	1 año	3 años	5 años	7 años	10 años
Santalucía Retorno Absoluto C FI	-0,44%	0,28%	1,32%	-0,58%		-1,10%

Riesgo

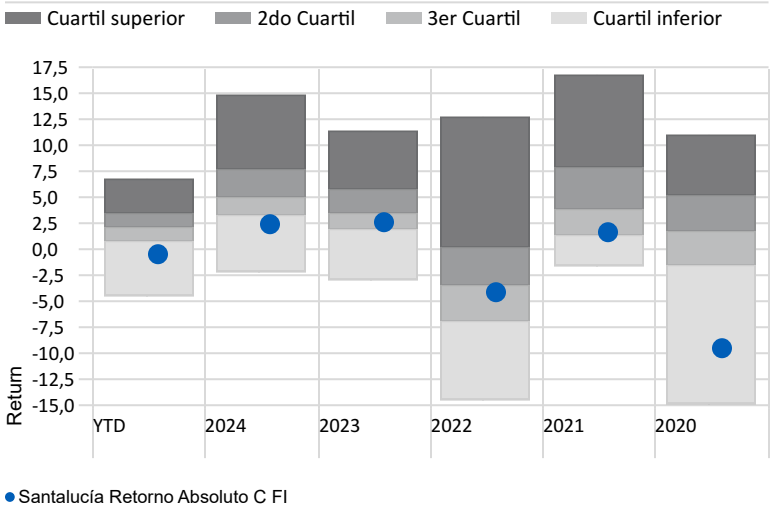
	Volatilidad	Alpha	Beta	R2	Sharpe	Tracking Error
Santalucía Retorno Absoluto C FI	3,37%				-0,79	

Rentabilidad - Riesgo

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



Rentabilidad vs. Benchmark



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 facilita...

Fuente: Morningstar Direct