

Datos identificativos

ISIN	ES0112187028
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	8,96 €
Política de dividendos	Acc
Gastos Corrientes	1,61%
Comisión de gestión	0,90%

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 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

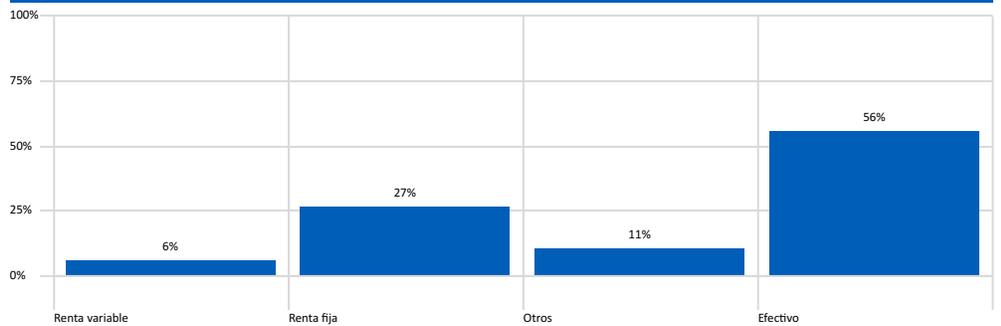
Fuente: Morningstar Direct

Evolución histórica



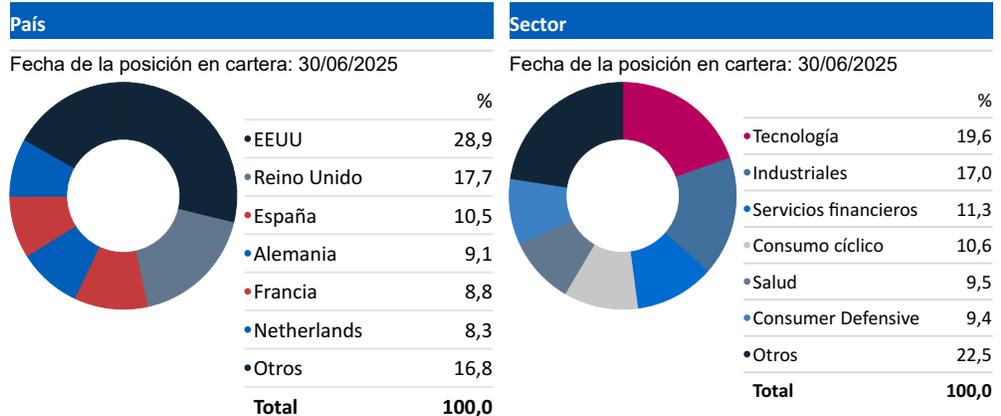
— Santalucía Retorno Absoluto B FI

Asignación activos



■ Santalucía Retorno Absoluto B FI

Renta Variable



Renta Fija

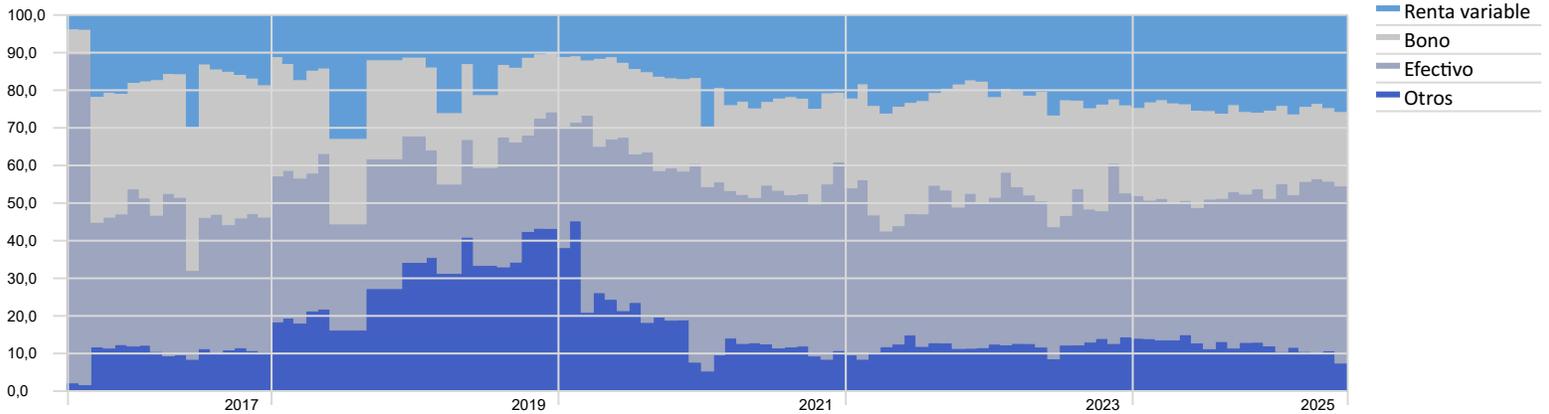


Rentabilidades mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2025	0,86%	-0,53%	-0,98%	-0,05%	0,19%	-0,10%	-0,07%						-0,70%
2024	0,10%	0,40%	0,39%	-0,03%	0,24%	0,61%	-0,15%	-0,05%	-0,08%	-0,15%	0,72%	0,09%	2,11%
2023	0,43%	-0,30%	-0,02%	0,17%	-0,14%	0,09%	0,23%	0,36%	-0,15%	-0,14%	0,76%	0,92%	2,25%
2022	-1,13%	-0,59%	0,16%	-0,81%	-0,89%	-0,73%	0,46%	-0,23%	-1,21%	-0,19%	0,24%	0,35%	-4,48%
2021	0,08%	0,29%	0,10%	0,36%	-0,12%	0,30%	0,10%	0,09%	-0,31%	-0,04%	-0,07%	0,43%	1,22%

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 B FI -0,70% -0,17% 0,86% -1,03% -1,58%

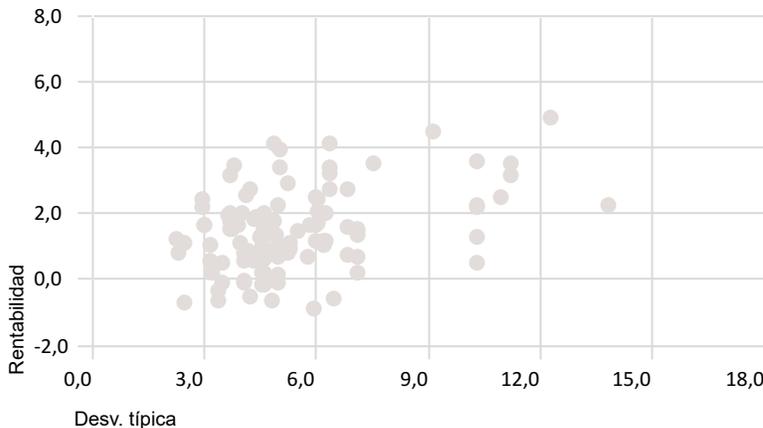
Riesgo

Volatilidad Alpha Beta R2 Sharpe Tracking Error

Santalucía Retorno Absoluto B FI

Rentabilidad - Riesgo

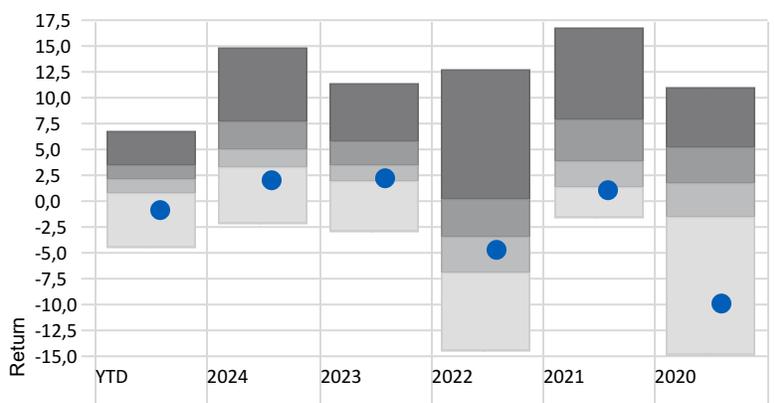
Peer Group (5-95%): Funds - Europe/Africa/Asia - Multistrategy EUR



* Santalucía Retorno Absoluto B FI

Rentabilidad vs. Benchmark

Cuartil superior 2do Cuartil 3er Cuartil Cuartil inferior



● Santalucía Retorno Absoluto B 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...