

## Datos identificativos

ISIN	ES0112187036
Patrimonio del fondo	15.300.362 €
Fecha de lanzamiento	01/07/2016
Divisa	Euro
Inversión mínima	1.000.000 €
Rating Morningstar	★
Rating Sostenibilidad Morningstar	
Fecha de Cartera	30/06/2025
Nivel de Riesgo CNMV (sobre 7)	2
VL Cierre de Mes	9,65 €
Política de dividendos	Acc
Gastos Corrientes	0,81%
Comisión de gestión	0,10%

## 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

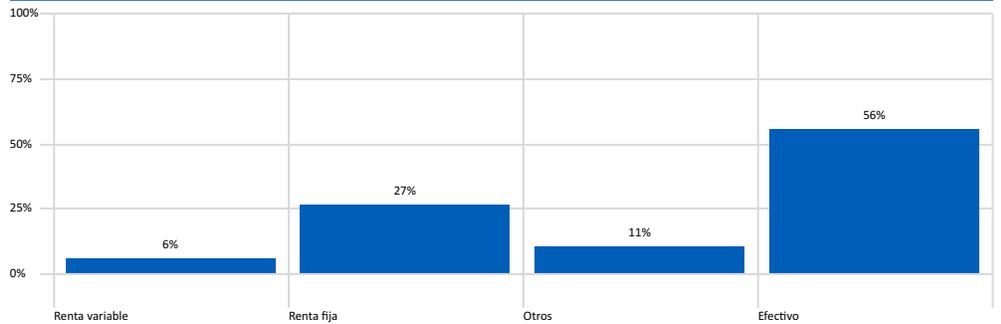
Gestora	Santalucía Asset Management SGIC
CIF	A-85534667
Depositario	Cecabank, S.A.
Auditor	Ersnt & Young
Sitio web	www.santaluciaam.es
Dirección	Plaza de España, 15 (Madrid)
Teléfono	(+34) 91 297 16 70

Fuente: Morningstar Direct

## Evolución histórica

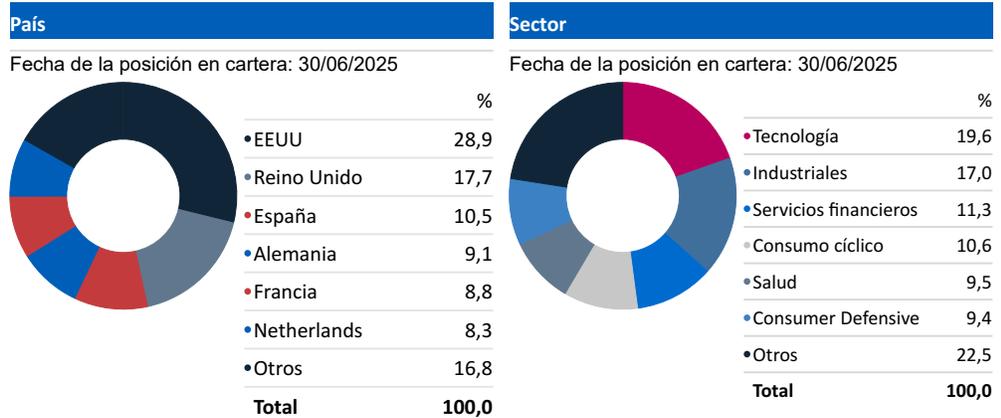


## Asignación activos



## Santalucía Retorno Absoluto A FI

### Renta Variable



### Renta Fija

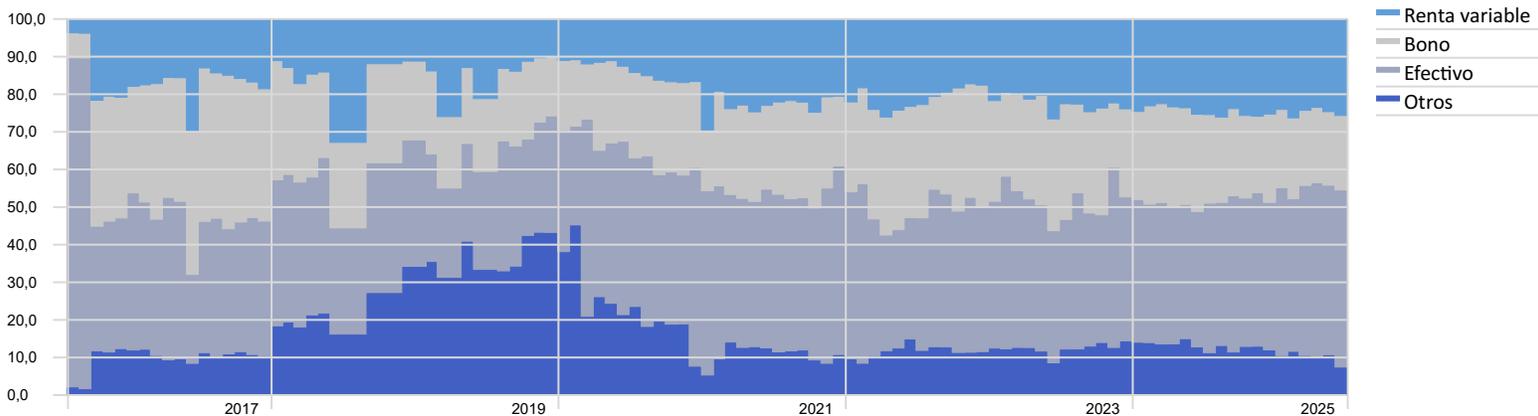


## Rentabilidades mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2025	0,93%	-0,47%	-0,92%	0,01%	0,25%	-0,03%	0,00%						-0,24%
2024	0,17%	0,47%	0,45%	0,04%	0,30%	0,68%	-0,07%	0,02%	-0,01%	-0,08%	0,79%	0,16%	2,93%
2023	0,50%	-0,23%	0,05%	0,24%	-0,06%	0,15%	0,30%	0,42%	-0,09%	-0,07%	0,83%	0,99%	3,07%
2022	-1,06%	-0,53%	0,23%	-0,74%	-0,82%	-0,67%	0,52%	-0,15%	-1,14%	-0,13%	0,32%	0,42%	-3,71%
2021	0,14%	0,35%	0,18%	0,43%	-0,05%	0,37%	0,16%	0,16%	-0,24%	0,02%	0,00%	0,50%	2,03%

## Evolución exposición por tipo de activo

Periodo de tiempo: Desde creación a 30/06/2025



## Rentabilidad anualizada

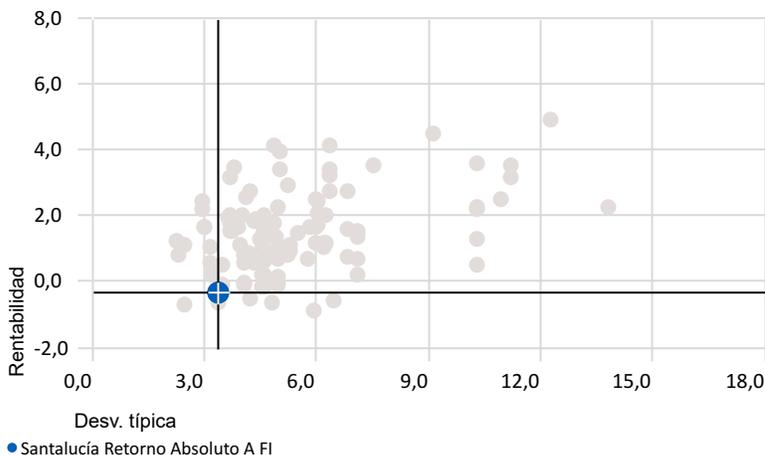
	YTD	1 año	3 años	5 años	7 años	10 años
Santalucía Retorno Absoluto A FI	-0,23%	0,63%	1,67%	-0,24%	-0,78%	

## Riesgo

	Volatilidad	Alpha	Beta	R2	Sharpe	Tracking Error
Santalucía Retorno Absoluto A FI	3,37%					-0,72

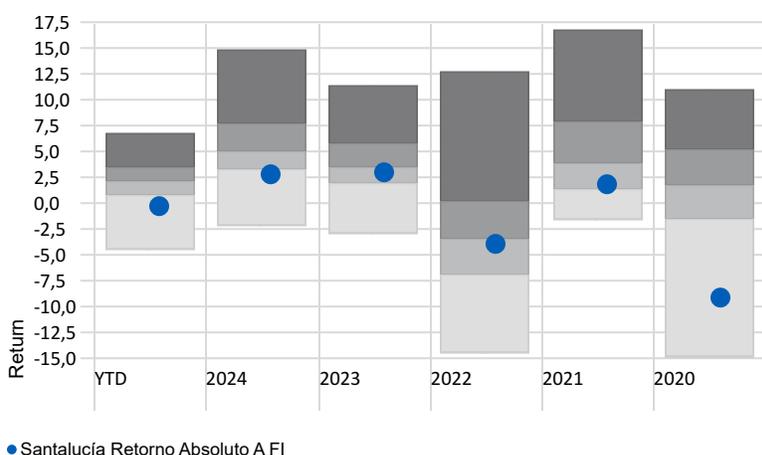
## Rentabilidad - Riesgo

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



## Rentabilidad vs. Benchmark

Cuartil superior 2do Cuartil 3er Cuartil Cuartil inferior



## 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, SGIIC, SA no tendrá responsabilidad alguna por cualquier reclamación derivada del uso de la información facilitada...