

BELGRAVIA EPSILON FI, R

POLÍTICA DE INVERSIÓN

El universo de inversión de Belgravia Epsilon FI es la renta variable paneuropea, sobre la que se realiza una gestión activa. El Fondo tiene un objetivo de rentabilidad positiva con un ratio de Sharpe superior al del Stoxx 600, manteniendo una volatilidad inferior a la de dicho índice.

DATOS DEL FONDO

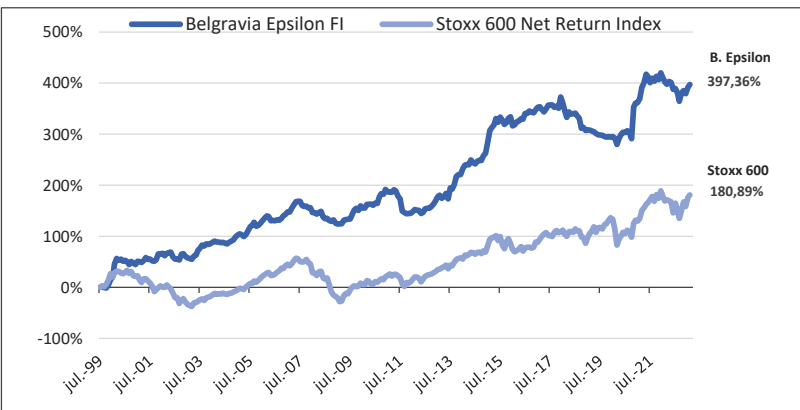
NAV a 28/02/2023	2.678,94 EUR
Patrimonio	85,23 m EUR
Código ISIN	ES0114353032
Código Bloomberg	BELEPSI SM Equity
Categoría	Retorno absoluto
Estructura legal	Fondo de Inversión, UCITS

Domicilio	España
Nº registro CNMV	2721
Sociedad gestora	Sinagular AM, SGIIC, SAU
Depositario	Caceis Bank Spain SAU
Auditor	Deloitte
Director de gestión	Carlos Cerezo

Inversión mínima inicial	10.000 EUR
Inversión mínima adicional	1.000 EUR
Liquidación	D+1
Liquidez	Diaria
Comisión de gestión	1,25%
Comisión s/ resultados positivos	9%
Comisión de suscripción	0%
Comisión de reembolso	0%
Comisión de depositaria	0,1%

Relación con inversores	Cristina Solinís
Teléfono	91 515 85 90
Correo electrónico	info@singularam.es

TRACK RECORD^{1,2}



Año	Rentabilidad (%)		Volatilidad* (%)		Ratio de Sharpe*	
	Epsilon	Stoxx 600	Epsilon	Stoxx 600	Epsilon	Stoxx 600
1999	14,75	26,50	-	-	-	-
2000	25,99	-3,83	11,61	18,68	1,87	-
2001	14,60	-15,65	10,08	22,67	1,04	-
2002	-3,01	-30,36	8,81	28,30	-	-
2003	15,49	15,92	7,02	21,04	1,90	0,65
2004	6,97	12,24	4,30	11,47	1,16	0,89
2005	13,72	26,68	4,78	9,40	2,44	2,62
2006	7,66	20,80	6,30	12,75	0,76	1,40
2007	5,37	2,36	7,18	15,99	0,22	-
2008	-11,96	-43,77	7,24	36,73	-	-
2009	15,10	32,39	7,48	24,40	1,95	1,31
2010	12,35	11,61	8,14	18,67	1,48	0,61
2011	-16,01	-8,61	9,33	22,19	-	-
2012	10,07	18,18	7,30	14,91	1,39	1,22
2013	19,05	20,79	9,15	12,14	2,08	1,71
2014	13,02	7,20	8,63	13,43	1,51	0,54
2015	19,65	9,60	9,51	19,98	2,10	0,50
2016	3,20	1,73	4,03	19,77	0,97	0,12
2017	5,53	10,58	5,17	8,37	1,22	1,36
2018	-13,86	-10,77	6,54	12,62	-	-
2019	-3,20	26,82	1,30	11,40	-	2,40
2020	16,88	-1,99	12,48	27,88	1,40	-
2021	12,91	24,91	6,86	12,43	1,98	2,06
2022	-7,82	-10,64	6,95	19,08	-	-
2023	3,73	8,74	4,14	10,47	0,81	0,80

*Calculado con observaciones diarias

ESTADÍSTICAS^{1,2}

Desde inicio (julio de 1999)	Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad media mensual (%)	0,61	0,47
Rentabilidad anualizada (%)	7,04	4,48
Volatilidad mensual (%)	2,79	4,46
Volatilidad anualizada (%)	9,66	15,45
Alfa anualizado (%)	4,39	-
Ratio de Sharpe	0,62	0,22
Máxima caída (%)	-19,62	-54,34

febrero-23	Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad (%)	1,21	1,88
Inversión bruta media RV (%)	99,88	100
Inversión neta media RV (%)	34,49	100
VaR diario medio (%)	0,53	1,18
Beta media	0,34	1

28 de febrero de 2023	Epsilon	Stoxx 600
Inversión bruta RV (%)	114,60	100
Inversión neta RV (%)	26,60	100
VaR (%)	0,49	1,14
Beta	0,23	1
Rent. anualizada a 5 años (%)	2,17	6,60
Vol. anualizada a 5 años (%)	9,42	16,20
Ratio de Sharpe a 5 años	0,27	0,43

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)	
Alemania	11,36
Benelux	13,51
Escandinavia	12,37
España	8,32
Francia	20,14
Irlanda	7,05
Italia	-
Portugal	2,94
Reino Unido	15,15
Suiza	6,32
Otros	2,85

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)	
Large Caps (> 5.000 M.€)	80,10
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	11,97
Small Caps (< 1.000 M.€)	7,93

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)

NORDEA BANK ABP	3,30
CARLSBERG AS-B	3,14
CAIXABANK SA	3,14

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)	
Telecomunicaciones	4,96
Consumo cíclico	30,02
Consumo no cíclico	24,40
Energía	2,45
Financiero	9,12
Industrial	10,10
Materias Primas	3,77
Salud	-
Servicios públicos	4,35
Tecnología	10,82

EXPOSICIÓN CARTERA (%)	
Liquidez	29,40
Contado RV	70,60
Futuros Eurostoxx 50	-44,00
Inversión Neta RV	26,60

VALLOUREC SA	3,04
ESSILORLUXOTTICA	2,99
PORSCHE AG	2,68

1. Desde Julio de 1999 hasta Agosto de 2004, el comportamiento histórico corresponde a Belgravia Beta SICAV, sociedad con la misma política de inversión que se fusionó con Belgravia Epsilon FI en Abril de 2017.

2. La serie del Stoxx 600 utilizada en este informe (SX0R: STOXX Europe 600 Net Return Index EUR) incluye dividendos netos desde inicio.



BELGRAVIA EPSILON FI

Menor riesgo



Potencialmente
menor rendimiento

Mayor riesgo

Potencialmente
mayor rendimiento

Este dato es indicativo del riesgo del fondo que, no obstante puede no constituir una indicación fiable del futuro perfil de riesgo. Además, no hay garantías de que la categoría indicada vaya a permanecer inalterable y puede variar a lo largo del tiempo. ¿Por qué en esta categoría? Se invierte en renta variable o en renta fija, fundamentalmente de emisores y mercados europeos, sin predeterminación por tipo de activos, pudiendo existir riesgo divisa.

Las rentabilidades pasadas no garantizan rentabilidades futuras. El valor de las inversiones y de sus rendimientos pueden variar y el inversor puede no recuperar su inversión inicial. Puede consultar el folleto oficial en la página web de CNMV. Este documento es informativo y no supone oferta o recomendación para suscribir participaciones (no asumiendo Singular Bank ningún tipo de responsabilidad por el uso que pueda hacerse de la presente información).