

31 de marzo de 2023

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

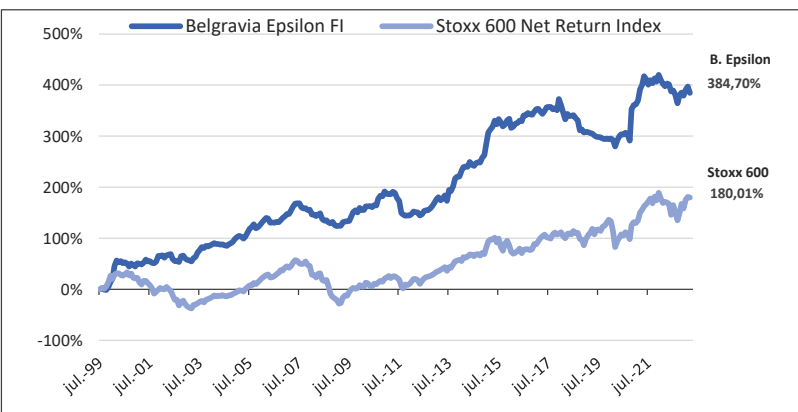
NAV a 31/03/2023	2.610,73 EUR
Patrimonio	84,48 m EUR
Código ISIN	ES0114353032
Código Bloomberg	BELEPSI SM Equity
Categoría	Retorno absoluto
Estructura legal	Fondo de Inversión, UCITS

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	1,09	8,39	4,81	14,39	0,14	0,56

*Calculado con observaciones diarias

ESTADÍSTICAS^{1,2}

Desde inicio (julio de 1999)	Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad media mensual (%)	0,59	0,46
Rentabilidad anualizada (%)	6,90	4,45
Volatilidad mensual (%)	2,79	4,45
Volatilidad anualizada (%)	9,66	15,42
Alfa anualizado (%)	4,27	-
Ratio de Sharpe	0,60	0,22
Máxima caída (%)	-19,62	-54,34

marzo-23	Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad (%)	-2,55	-0,32
Inversión bruta media RV (%)	92,93	100
Inversión neta media RV (%)	20,15	100
VaR diario medio (%)	0,47	1,31
Beta media	0,15	1

31 de marzo de 2023	Epsilon	Stoxx 600
Inversión bruta RV (%)	72,77	100
Inversión neta RV (%)	15,38	100
VaR (%)	0,49	1,43
Beta	0,09	1
Rent. anualizada a 5 años (%)	2,28	6,96
Vol. anualizada a 5 años (%)	9,39	16,16
Ratio de Sharpe a 5 años	0,28	0,45

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)	
Alemania	14,60
Benelux	10,35
Escandinavia	15,46
España	8,26
Francia	17,61
Irlanda	4,87
Italia	-
Portugal	5,32
Reino Unido	13,62
Suiza	4,72
Otros	5,18

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)	
Large Caps (> 5.000 M.€)	79,91
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	9,09
Small Caps (< 1.000 M.€)	11,00

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)

CARLSBERG AS-B	3,38
ESSILORLUXOTTICA	2,53
ESSITY AKTIEBOLAG-B	2,39

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)	
Telecomunicaciones	7,69
Consumo cíclico	29,23
Consumo no cíclico	31,52
Energía	1,25
Financiero	4,69
Industrial	7,91
Materias Primas	1,12
Salud	-
Servicios públicos	8,87
Tecnología	7,72

EXPOSICIÓN CARTERA (%)	
Liquidez	55,92
Contado RV	44,08
Futuros Eurostoxx 50	-28,70
Inversión Neta RV	15,38

EDP-ENERGIAS	2,34
MERCK KGAA	2,31
HELLENIC TELECOM	2,28

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. Ambas IIC fusionadas tenían carteras sustancialmente idénticas. Los rendimientos pasados no constituyen indicador fiable de resultados futuros.

3. La serie del Stoxx 600 utilizada en este informe (SX0X: STOXX Europe 600 Net Return Index EUR) incluye dividendos netos desde inicio.



Calificación Morningstar 5 estrellas, Silver

BELGRAVIA EPSILON FI

Menor riesgo



Potencialmente
menor rendimiento

Mayor riesgo

Potencialmente
mayor rendimiento

El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo 3 en una escala de 7, en la que 3 significa riesgo medio bajo. Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como media baja. Este indicador hace referencia al nivel de riesgo al que se puede ver expuesto el valor de la participación en este producto financiero, es decir, a las potenciales subidas y bajadas de su inversión. El resto de riesgos se describen en el folleto del producto financiero.

Este dato es indicativo del riesgo del producto de inversión y está calculado en base a datos históricos 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.

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).