Belgravia Capital

Singular Asset Management S.G.I.I.C.

31 de diciembre de 2021

BELGRAVIA LUX UCITS, EPSILON R

POLÍTICA DE INVERSIÓN

El universo de inversión de Belgravia Lux Epsilon 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 volatildad inferior a la de dicho índice.

DATOS DEL FONDO

NAV a 31/12/2021	**124 EUR**
Patrimonio	**12,85 m EUR**
Código ISIN	LU1808857905
Código Bloomberg	BELLUER LX Equity
Categoría	Retorno absoluto
Estructura legal	SICAV, UCITS
Domicilio	Luxemburgo
Nº registro CNMV	1761
Sociedad gestora	Singular AM, SGIIC, SAU
Depositario	Pictet & Cie (Europe) S.A.
Auditor	Ernst & Young
Director de gestión	Carlos Cerezo
Inversión mínima inicial	-
Inversión mínima adicional	-
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 depositaría	0,05%
Relación con inversores	Cristina Solinís
Teléfono	91 515 85 90
Correo electrónico	info@singularam.es

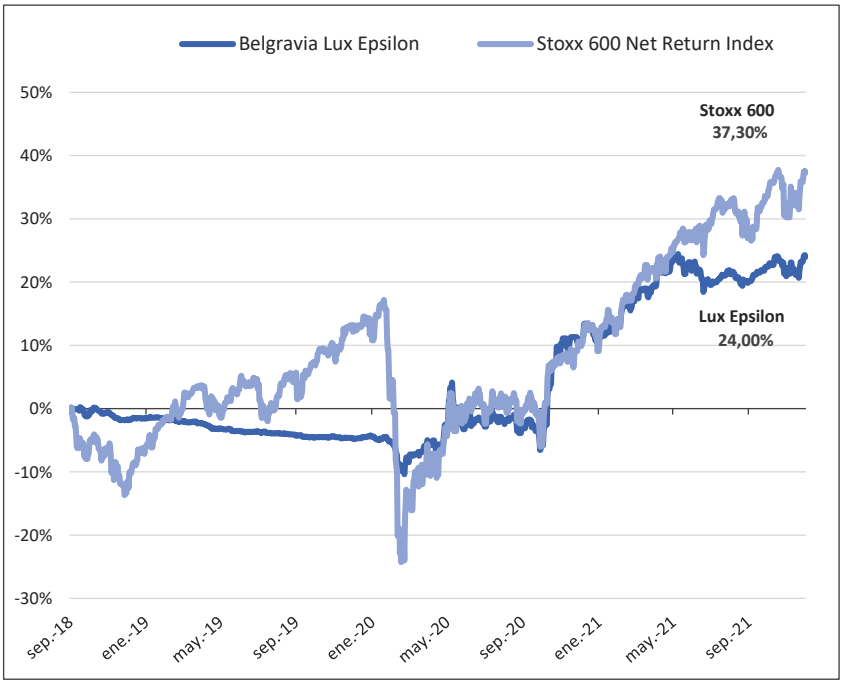
ESTADÍSTICAS [1, 2]

Desde inicio (Sept. de 2018)	Lux Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad media mensual (%)	**0,59**	0,93
Rentabilidad anualizada (%)	**6,84**	10,24
Volatilidad mensual (%)	**2,89**	4,80
Volatilidad anualizada (%)	**10,00**	16,61
Alfa anualizado (%)	**2,79**	-
Ratio de Sharpe	**0,75**	0,66
Máxima caída (%)	**-7,89**	-22,57

diciembre-21	Lux Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad (%)	**2,55**	5,42
Inversión bruta media RV (%)	**95,08**	100
Inversión neta media RV (%)	**63,19**	100
VaR diario medio (%)	**0,55**	1,34
Beta media	**0,55**	1

31 de diciembre de 2021	Lux Epsilon	Stoxx 600
Inversión bruta RV (%)	**83,62**	100
Inversión neta RV (%)	**83,62**	100
VaR (%)	**0,60**	1,37
Beta	**0,77**	1

TRACK RECORD [1, 2]



	Rentabilidad (%)		Volatilidad* (%)		Ratio de Sharpe*	
Año	Lux Epsi.	Stoxx 600	Lux Epsi.	Stoxx 600	Lux Epsi.	Stoxx 600
2018	-1,71	-11,57	-	-	-	-
2019	-3,11	26,82	1,10	11,40	-	2,40
2020	15,89	-1,99	12,18	27,88	1,36	-
2021	12,36	24,91	6,89	12,43	1,89	2,06

*Calculado con observaciones diarias.

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)

Alemania	17,65
Benelux	20,05
Escandinavia	1,92
España	8,06
Francia	21,91
Italia	-
Irlanda	1,34
Portugal	3,54
Reino Unido	13,22
Suiza	5,81
Otros	6,49

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)

Telecomunicaciones	10,23
Consumo cíclico	23,84
Consumo no cíclico	9,82
Energía	-
Financiero	14,42
Industrial	25,20
Materias Primas	1,84
Salud	-
Servicios públicos	7,41
Tecnología	7,24

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)

Large Caps (> 5.000 M.€)	89,49
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	5,24
Small Caps (< 1.000 M.€)	5,27

EXPOSICIÓN CARTERA (%)

Liquidez	16,38
Contado RV	83,62
Futuros Eurostoxx 50	0,00
Inversión Neta RV	83,62

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)

SIMENS	3,64
INDITEX	3,55
RECKITT BENCKISER	3,39
KION	3,35
SAINT-GOBAIN	3,31
IBERDROLA	3,27

1. Los datos de este infome han sido calculados con observaciones diarias.

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

BELGRAVIA LUX UCITS, EPSILON R

Menor riesgo — Mayor riesgo

Potencialmente menor rendimiento

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).