Belgravia Capital

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

30 de junio de 2022

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 30/06/2022	**115,83 EUR**
Patrimonio	**11,92 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

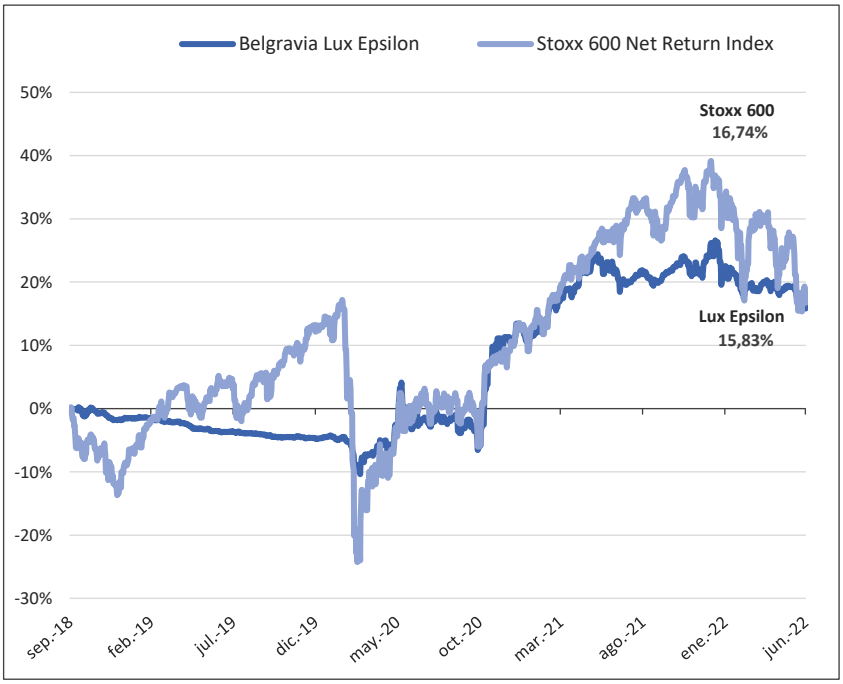
ESTADÍSTICAS [1, 2]

Desde inicio (Sept. de 2018)	**Lux Epsilon**	**Stoxx 600**
Rentabilidad media mensual (%)	**0,36**	0,46
Rentabilidad anualizada (%)	**4,00**	4,21
Volatilidad mensual (%)	**2,79**	4,75
Volatilidad anualizada (%)	**9,66**	16,44
Alfa anualizado (%)	**2,43**	-
Ratio de Sharpe	**0,48**	0,30
Máxima caída (%)	**-7,89**	-22,57

junio-22	**Lux Epsilon**	**Stoxx 600**
Rentabilidad (%)	**-2,88**	-8,02
Inversión bruta media RV (%)	**72,64**	100
Inversión neta media RV (%)	**23,46**	100
VaR diario medio (%)	**0,59**	2,35
Beta media	**0,14**	1

30 de junio de 2022	**Lux Epsilon**	**Stoxx 600**
Inversión bruta RV (%)	**70,15**	100
Inversión neta RV (%)	**21,08**	100
VaR (%)	**0,56**	2,32
Beta	**0,14**	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
2022	-6,59	-14,97	8,17	21,56	-	-

*Calculado con observaciones diarias.

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)

Alemania	11,71
Benelux	13,58
Escandinavia	-
España	11,71
Francia	28,63
Italia	1,17
Irlanda	3,88
Portugal	2,38
Reino Unido	23,90
Suiza	1,32
Otros	1,71

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)

Telecomunicaciones	3,88
Consumo cíclico	23,60
Consumo no cíclico	25,56
Energía	7,02
Financiero	4,23
Industrial	17,66
Materias Primas	5,25
Salud	-
Servicios públicos	5,71
Tecnología	7,08

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)

Large Caps (> 5.000 M.€)	75,47
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	21,05
Small Caps (< 1.000 M.€)	3,48

EXPOSICIÓN CARTERA (%)

Liquidez	54,38
Contado RV	45,62
Futuros Eurostoxx 50	-24,53
Inversión Neta RV	21,08

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)

COCA-COLA EURO.	2,28
VINCI	2,24
EURAPI	2,20
TESCO	2,12
MERCK KGAA	2,05
RYANAIR HOLDINGS	1,79

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).