

31 de octubre de 2023

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 volatilidad inferior a la de dicho índice.

DATOS DEL FONDO

NAV a 31/10/2023	101,83 EUR
Patrimonio	8,6 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 depositaria	0,05%

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

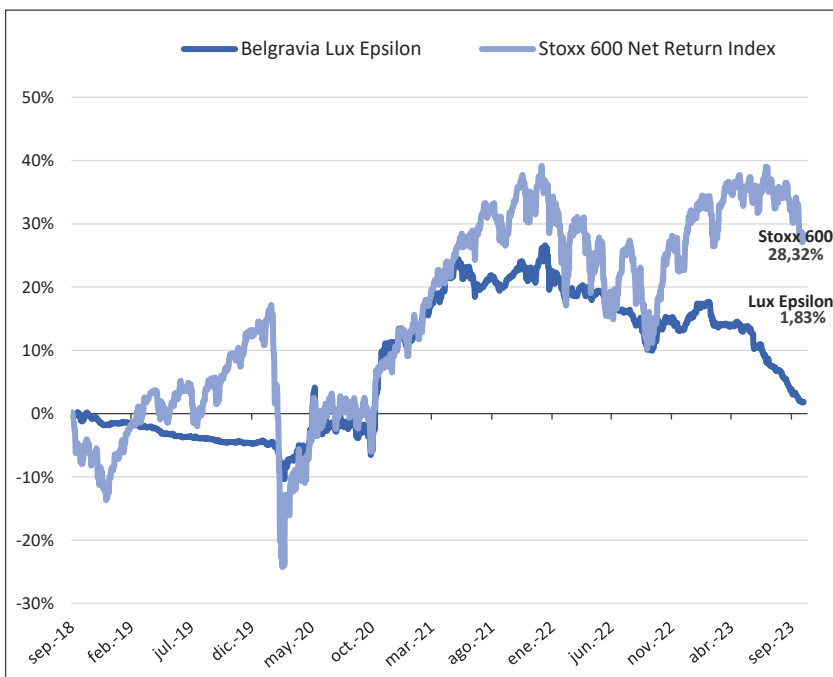
ESTADÍSTICAS ^{1,2}

Desde inicio (Sept. de 2018)	Lux Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad media mensual (%)	0,06	0,52
Rentabilidad anualizada (%)	0,36	5,03
Volatilidad mensual (%)	2,64	4,66
Volatilidad anualizada (%)	9,13	16,16
Alfa anualizado (%)	-1,77	-
Ratio de Sharpe	0,03	0,30
Máxima caída (%)	-17,88	-22,57

octubre-23	Lux Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad (%)	-1,90	-3,62
Inversión bruta media RV (%)	35,12	100
Inversión neta media RV (%)	13,52	100
VaR diario medio (%)	0,57	1,18
Beta media	0,08	1

31 de octubre de 2023	Lux Epsilon	Stoxx 600
Inversión bruta RV (%)	28,48	100
Inversión neta RV (%)	12,59	100
VaR (%)	0,46	1,23
Beta	0,08	1

TRACK RECORD ^{1,2}



Año	Rentabilidad (%)		Volatilidad* (%)		Ratio de Sharpe*	
	L. Epsilon	Stoxx 600	L. Epsilon	Stoxx 600	L. Epsilon	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	-8,66	-10,64	6,94	19,08	-	-
2023	-10,09	4,60	4,34	11,94	-	0,35

*Calculado con observaciones diarias.

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)

	Alemania	4,61
	Benelux	8,61
	Escandinavia	7,03
	España	12,59
	Francia	27,45
	Italia	7,97
	Irlanda	7,05
	Portugal	7,44
	Reino Unido	7,06
	Suiza	10,18
	Otros	-

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)

	Telecomunicaciones	-
	Consumo cíclico	7,30
	Consumo no cíclico	15,64
	Energía	-
	Financiero	-
	Industrial	19,91
	Materias Primas	-
	Salud	30,01
	Servicios públicos	15,02
	Tecnología	12,13

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)

Large Caps (> 5.000 M.€)	63,67
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	25,85
Small Caps (< 1.000 M.€)	10,48

EXPOSICIÓN CARTERA (%)

Liquidez	79,47
Contado RV	20,53
Futuros Eurostoxx 50	-7,95
Inversión Neta RV	12,59

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)

	ALCON INC	1,87
	EUROGROUP LAMINATIONS SPA	1,62
	ESSILORLUXOTTICA	1,58
	IBERDROLA SA	1,54
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,51
	CONVATEC GROUP PLC	1,44

1. Los datos de este informe 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

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. Este producto no incluye protección alguna contra la evolución futura del mercado, por lo que podría perder una parte o la totalidad de su inversión.

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).