

31 de mayo de 2020

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 31/05/2020	96,56 EUR
Patrimonio	8,01 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	Belgravia Capital, SGIIC, S.A.
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%

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

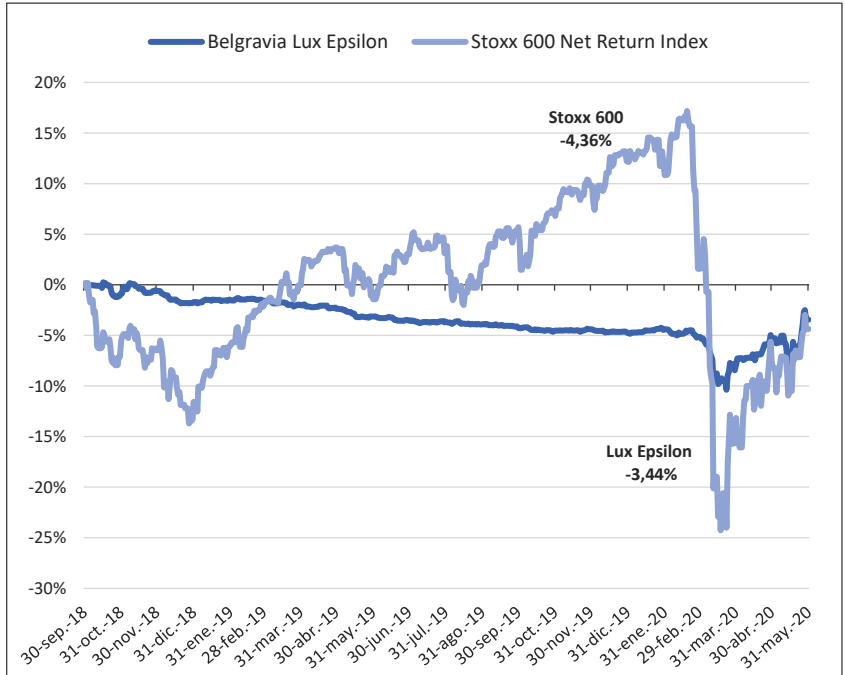
ESTADÍSTICAS 1, 2

Desde inicio (Sept. de 2018)	Lux Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad media mensual (%)	-0,17	-0,08
Rentabilidad anualizada (%)	-2,08	-2,64
Volatilidad mensual (%)	1,10	5,22
Volatilidad anualizada (%)	3,79	18,10
Alfa anualizado (%)	-1,36	-
Ratio de Sharpe	-	-
Máxima caída (%)	-7,89	-22,57

mayo-20	Lux Epsilon	Stoxx 600
Rentabilidad (%)	1,94	3,40
Inversión bruta media RV (%)	102,56	100
Inversión neta media RV (%)	48,07	100
VaR diario medio (%)	1,44	2,65
Beta media	0,48	1

31 de mayo de 2020	Lux Epsilon	Stoxx 600
Inversión bruta RV (%)	104,90	100
Inversión neta RV (%)	57,72	100
VaR (%)	1,84	2,64
Beta	0,63	1

TRACK RECORD 1, 2



Año	Rentabilidad (%)		Volatilidad* (%)		Ratio de Sharpe*	
	Lux Epsi.	Stoxx 600	Lux Epsi.	Stoxx 600	Lux Epsi.	Stoxx 600
2018	-1,71	-11,57	-	-	-	-
2019	-4,40	26,82	1,10	11,40	-	2,40
2020	1,40	-14,72	8,58	37,20	0,19	-

*Calculado con observaciones diarias.

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)

Alemania	16,34
Austria	-
Benelux	12,75
Escandinavia	3,76
España	5,58
Francia	42,69
Italia	5,31
Irlanda	1,17
Portugal	-
Reino Unido	7,10
Suiza	2,48
Otros	2,83

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)

Comunicaciones	19,61
Consumo cíclico	10,30
Consumo no cíclico	7,96
Energía	4,59
Financiero	17,46
Industrial	11,01
Materias Primas	16,33
Salud	6,63
Servicios públicos	3,81
Tecnología	2,29

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)

Large Caps (> 5.000 M.€)	60,81
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	31,82
Small Caps (< 1.000 M.€)	7,37

EXPOSICIÓN CARTERA (%)

Liquidez	18,69
Contado RV	81,31
Futuros Eurostoxx 50	-23,59
Inversión Neta RV	57,72

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)**

TELEFONICA DEUTSCH.	2,26
RECKITT BENCKISER	2,18
CARREFOUR SA	2,06
FRESENIUS	2,06
KONINKLIJKE AHOLD	2,04
WM MORRISON	1,96

** A 31/03/2020

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.