Belgravia Capital

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

31 de mayo de 2021

Q. I. BELGRAVIA LYNX

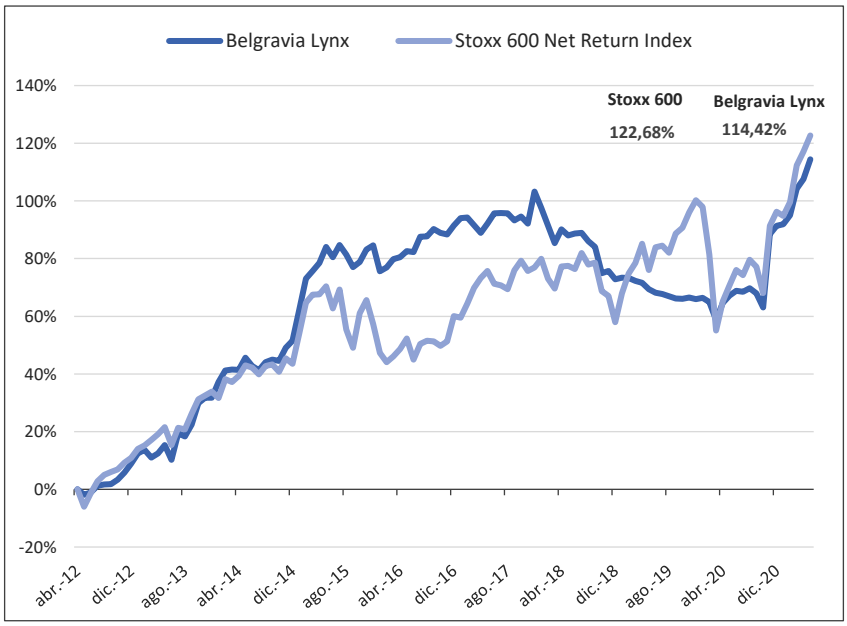
POLÍTICA DE INVERSIÓN

El universo de inversión de Q. I. Belgravia Lynx 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 31/05/2021	**195,97 EUR**
Patrimonio	**26,67 m EUR**
Código ISIN	LU0691314768
Código Bloomberg	AUBELXA LX Equity
Categoría	Retorno absoluto
Estructura legal	SICAV, UCITS
Domicilio	Luxemburgo
Nº registro CNMV	820
Sociedad gestora	Singular AM, SGIIC, SA
Depositario	Societe Generale Bank & Trust
Auditor	KPMG Audit SC
Director de gestión	Carlos Cerezo
Inversión mínima inicial	-
Inversión mínima adicional	-
Liquidación	D+1
Liquidez	Diaria
Comisión de gestión	1,35%
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

TRACK RECORD [1, 2]



	Rentabilidad (%)		Volatilidad* (%)		Ratio de Sharpe*	
Año	**Lynx**	**Stoxx 600**	**Lynx**	**Stoxx 600**	**Lynx**	**Stoxx 600**
2012	8,96	18,18	-	-	-	-
2013	20,92	20,79	11,28	12,14	1,86	1,71
2014	14,97	7,20	10,56	13,43	1,42	0,54
2015	21,83	9,60	11,83	19,98	1,88	0,50
2016	3,76	1,73	4,80	19,77	0,93	0,12
2017	6,12	10,58	6,11	8,37	1,13	1,36
2018	-14,94	-10,77	7,04	12,62	-	-
2019	-0,38	26,82	1,60	11,40	-	2,40
2020	15,35	-1,99	12,54	27,88	1,27	-
2021	12,03	13,46	7,49	11,96	1,64	1,15

*Calculado con observaciones diarias.

ESTADÍSTICAS [1, 2]

Desde inicio (abril de 2012)	**Lynx**	**Stoxx 600**
Rentabilidad media mensual (%)	**0,74**	0,81
Rentabilidad anualizada (%)	**8,76**	9,21
Volatilidad mensual (%)	**2,73**	3,84
Volatilidad anualizada (%)	**9,46**	13,32
Alfa anualizado (%)	**4,39**	-
Ratio de Sharpe	**0,97**	0,73
Máxima caída (%)	**-21,90**	-22,57

mayo-21	**Lynx**	**Stoxx 600**
Rentabilidad (%)	**3,32**	2,59
Inversión bruta media RV (%)	**116,18**	100
Inversión neta media RV (%)	**52,62**	100
VaR diario medio (%)	**1,23**	1,72
Beta media	**0,56**	1

31 de mayo de 2021	**Lynx**	**Stoxx 600**
Inversión bruta RV (%)	**125,87**	100
Inversión neta RV (%)	**58,41**	100
VaR (%)	**1,31**	1,80
Beta	**0,56**	1
Rent. anualizada a 5 años (%)	**3,26**	7,89
Vol. anualizada a 5 años (%)	**9,52**	14,19
Ratio de Sharpe a 5 años	**0,41**	0,60

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)

Alemania	9,70
Benelux	22,47
Escandinavia	-
España	5,72
Francia	17,43
Italia	5,56
Irlanda	2,39
Portugal	2,18
Reino Unido	18,48
Suiza	7,26
Otros	8,81

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)

Comunicaciones	9,88
Consumo cíclico	10,82
Consumo no cíclico	6,75
Energía	4,27
Financiero	11,81
Industrial	33,06
Materias Primas	18,54
Salud	2,69
Servicios públicos	2,18
Tecnología	-

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)

Large Caps (> 5.000 M.€)	59,16
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	32,23
Small Caps (< 1.000 M.€)	8,61

EXPOSICIÓN CARTERA (%)

Liquidez	7,86
Contado RV	92,14
Futuros Eurostoxx 50	-33,73
Inversión Neta RV	58,41

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)**

VIVENDI	4,76
HEIDELBERGCEMENT AG	3,40
STELLANTIS NV	3,39
POSTNL NV	3,35
ACERINOX SA	3,27
EDP-ENERGIAS DE PORTU	3,10

** A 31/03/2021

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.

Morningstar Awards 2016

Calificación 3 estrellas Morningstar