Belgravia Capital

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

31 de mayo de 2022

Q. I. BELGRAVIA LYNX

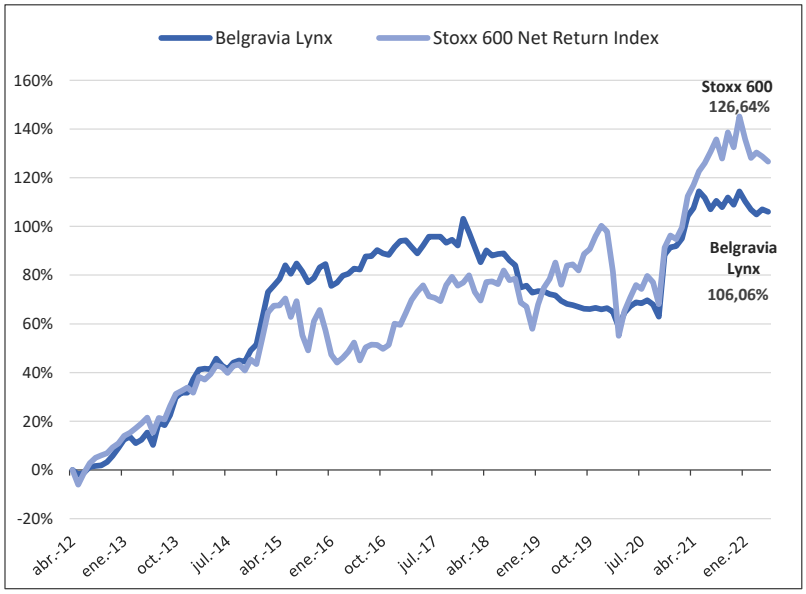
POLÍTICA DE INVERSIÓN

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 31/05/2022	**188,33 EUR**
Patrimonio	**24,4 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, SAU
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%
Comisión de depositaría	0,03%
Relación con inversores	Cristina Solinís
Teléfono	91 515 85 90
Correo electrónico	info@singularam.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	12,02	24,91	6,94	12,43	1,83	2,06
2022	-3,89	-7,55	8,66	21,55	-	-

*Calculado con observaciones diarias.

ESTADÍSTICAS [1, 2]

Desde inicio (abril de 2012)	**Lynx**	**Stoxx 600**
Rentabilidad media mensual (%)	**0,63**	0,75
Rentabilidad anualizada (%)	**7,43**	8,45
Volatilidad mensual (%)	**2,66**	3,77
Volatilidad anualizada (%)	**9,21**	13,07
Alfa anualizado (%)	**3,54**	-
Ratio de Sharpe	**0,86**	0,68
Máxima caída (%)	**-21,90**	-22,57

mayo-22	**Lynx**	**Stoxx 600**
Rentabilidad (%)	**-0,49**	-0,92
Inversión bruta media RV (%)	**105,28**	100
Inversión neta media RV (%)	**55,84**	100
VaR diario medio (%)	**0,96**	2,37
Beta media	**0,20**	1

31 de mayo de 2022	**Lynx**	**Stoxx 600**
Inversión bruta RV (%)	**108,34**	100
Inversión neta RV (%)	**55,00**	100
VaR (%)	**0,68**	2,25
Beta	**0,17**	1
Rent. anualizada a 5 años (%)	**1,40**	5,22
Vol. anualizada a 5 años (%)	**9,66**	14,35
Ratio de Sharpe a 5 años	**0,21**	0,41

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)

Alemania	11,92
Benelux	15,73
Escandinavia	-
España	6,79
Francia	26,84
Italia	1,48
Irlanda	4,16
Portugal	2,55
Reino Unido	22,78
Suiza	5,84
Otros	1,91

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)

Telecomunicaciones	4,30
Consumo cíclico	24,37
Consumo no cíclico	20,93
Energía	8,33
Financiero	8,68
Industrial	15,39
Materias Primas	5,91
Salud	-
Servicios públicos	5,51
Tecnología	6,59

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)

Large Caps (> 5.000 M.€)	80,02
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	15,00
Small Caps (< 1.000 M.€)	4,98

EXPOSICIÓN CARTERA (%)

Liquidez	18,33
Contado RV	81,67
Futuros Eurostoxx 50	-26,67
Inversión Neta RV	55,00

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)

TOTAL ENERGIES	2,50
COCA-COLA EURO.	2,16
RYANAIR	2,13
VINCI	1,99
MERCK KGAA	1,80
BP	1,77

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 4 estrellas Morningstar

Q. I. BELGRAVIA LYNX

Menor riesgo — Mayor riesgo

Potencialmente menor rendimiento

Potencialmente mayor rendimiento

El indicador anterior muestra las caracteísticas de riesgo y retribucuión del fondo, que se basan en la rentabilidad histórica del fondo durante los últimos 5 años. 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).