31 de agosto de 2019

Q. I. BELGRAVIA LYNX

Morningstar ★★★ Bronze

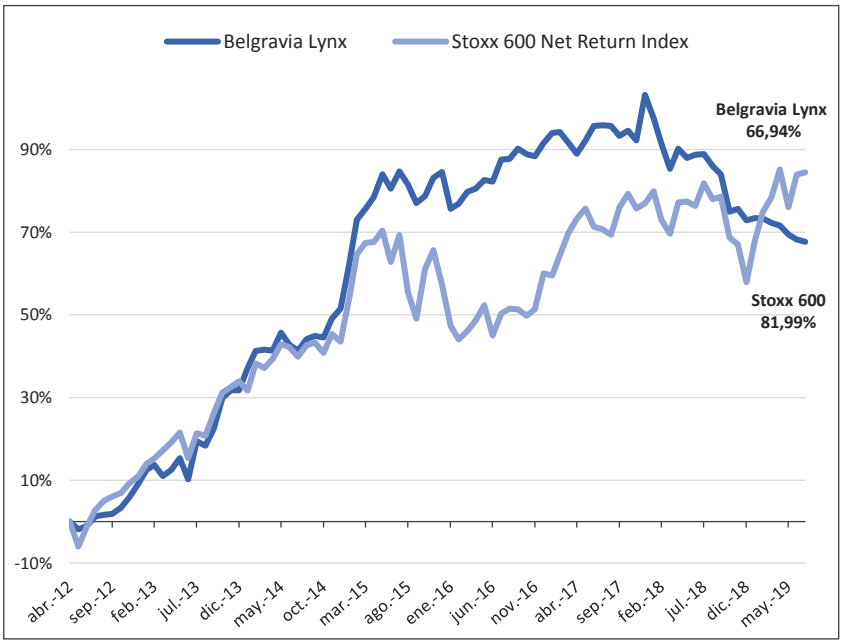
POLÍTICA DE INVERSIÓN

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 31/08/2019	**152,58 EUR**
Patrimonio	**28,35 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	Belgravia Capital, SGIIC, S.A.
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	12,19	-	-
2019	-3,42	15,25	1,73	11,66	-	1,34

*Calculado con observaciones diarias.

ESTADÍSTICAS [1, 2]

Desde inicio (abril de 2012)	**Lynx**	**Stoxx 600**
Rentabilidad media mensual (%)	**0,61**	0,74
Rentabilidad anualizada (%)	**7,24**	8,51
Volatilidad mensual (%)	**2,41**	3,31
Volatilidad anualizada (%)	**8,35**	11,48
Alfa anualizado (%)	**3,69**	-
Ratio de Sharpe	**0,92**	0,78
Máxima caída (%)	**-17,85**	-15,48

agosto-19	**Lynx**	**Stoxx 600**
Rentabilidad (%)	**-0,44**	-1,35
Inversión bruta media RV (%)	**53,50**	100
Inversión neta media RV (%)	**4,51**	100
VaR diario medio (%)	**0,14**	1,17
Beta media	**0,00**	1

31 de agosto de 2019	**Lynx**	**Stoxx 600**
Inversión bruta RV (%)	**50,92**	100
Inversión neta RV (%)	**4,37**	100
VaR (%)	**0,13**	1,16
Beta	**0,00**	1
Rent. anualizada a 5 años (%)	**2,98**	4,98
Vol. anualizada a 5 años (%)	**7,79**	12,28
Ratio de Sharpe a 5 años	**0,46**	0,45

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)

Alemania	19,49
Benelux	15,27
Escandinavia	4,48
España	9,36
Francia	27,91
Italia	3,81
Portugal	5,18
Reino Unido	12,67
Otros	1,82

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)

Comunicaciones	15,00
Consumo cíclico	9,60
Consumo no cíclico	17,67
Energía	-
Financiero	8,41
Industrial	7,20
Materias Primas	5,32
Salud	23,77
Servicios públicos	7,01
Tecnología	6,03

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)

Large Caps (> 5.000 M.€)	85,02
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	7,90
Small Caps (< 1.000 M.€)	7,08

EXPOSICIÓN CARTERA (%)

Liquidez	72,35
Contado RV	27,65
Futuros Eurostoxx 50	-23,28
Inversión Neta RV	4,37

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)**

KONINKLIJKE PHILIPS	1,44
SCOR	1,42
FRESENIUS	1,37

RECKITT BENCKISER	1,34
VIVENDI	1,24
SIEMENS	1,24

** A 30/06/2019

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 · CITYWIRE GOLD · Funds People 2017 ABC · Belgravia Capital