

30 de junio de 2020

Q. I. BELGRAVIA LYNX

Calificación Morningstar 4 estrellas

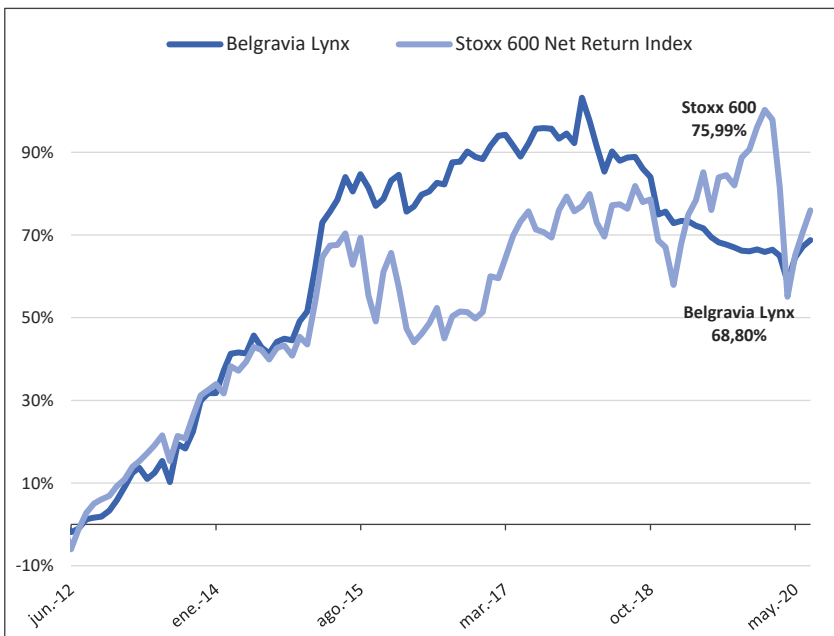
POLÍTICA DE INVERSIÓN

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 volatilidad inferior a la de dicho índice.

DATOS DEL FONDO

NAV a 30/06/2020	154,28 EUR
Patrimonio	15,51 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}



Año	Rentabilidad (%)		Volatilidad* (%)		Ratio de Sharpe*	
	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	1,73	-12,12	12,63	35,63	0,16	-

*Calculado con observaciones diarias.

ESTADÍSTICAS^{1,2}

Desde inicio (abril de 2012)	Lynx	Stoxx 600
Rentabilidad media mensual (%)	0,56	0,65
Rentabilidad anualizada (%)	6,62	7,17
Volatilidad mensual (%)	2,36	3,71
Volatilidad anualizada (%)	8,18	12,84
Alfa anualizado (%)	4,00	-
Ratio de Sharpe	0,86	0,59
Máxima caída (%)	-21,90	-22,57

junio-20	Lynx	Stoxx 600
Rentabilidad (%)	0,97	3,06
Inversión bruta media RV (%)	114,60	100
Inversión neta media RV (%)	65,88	100
VaR diario medio (%)	2,16	2,67
Beta media	0,73	1

30 de junio de 2020	Lynx	Stoxx 600
Inversión bruta RV (%)	114,48	100
Inversión neta RV (%)	67,11	100
VaR (%)	2,24	2,65
Beta	0,71	1
Rent. anualizada a 5 años (%)	-1,33	1,57
Vol. anualizada a 5 años (%)	6,54	14,10
Ratio de Sharpe a 5 años	-	0,16

CARTERA

DISTRIBUCIÓN RV POR PAÍSES (%)

🇩🇪 Alemania	11,71
🇦🇹 Austria	-
🇧🇪 Benelux	11,31
🇸🇪 Escandinavia	4,60
🇪🇸 España	8,27
🇫🇷 Francia	41,21
🇮🇹 Italia	5,18
🇮🇪 Irlanda	-
🇵🇹 Portugal	2,13
🇬🇧 Reino Unido	11,14
🇨🇭 Suiza	1,7
🌐 Otros	2,81

DISTRIBUCIÓN RV POR SECTORES (%)

📶 Comunicaciones	18,66
🛒 Consumo cíclico	10,24
🛒 Consumo no cíclico	5,19
⚡ Energía	4,22
🏦 Financiero	21,28
🏭 Industrial	13,16
🌳 Materias Primas	13,76
🏥 Salud	5,49
🏛️ Servicios públicos	3,81
💻 Tecnología	4,19

DISTRIB. RV POR CAPITALIZACIÓN (%)

Large Caps (> 5.000 M.€)	53,47
Mid Caps (1.000 a 5.000 M.€)	37,16
Small Caps (< 1.000 M.€)	9,37

EXPOSICIÓN CARTERA (%)

Liquidez	9,21
Contado RV	90,79
Futuros Eurostoxx 50	-23,68
Inversión Neta RV	67,11

PRINCIPALES POSICIONES RV (% PATRIMONIO)**

🇪🇸 TELEFONICA DEUTSCH.	2,37	🇳🇱 KONINKLIJKE AHOLD	2,20
🇬🇧 RECKITT BENCKISER	2,32	🇩🇪 FRESENIUS SE	2,16
🇫🇷 CARREFOUR SA	2,20	🇬🇧 WM MORRISON	2,04

** 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.