

FIDELIO DYNAMIC INCOME D

Abril 2023

Información general



Soledad Castellano

| | |
|----------------------|-------------------|
| Gestor | Alejandro Uriarte |
| ISIN | LU2109609292 |
| Fecha de lanzamiento | 06/02/2020 |
| Divisa de Clase | USD |
| Aportación Mínima | 50.000,00 \$ |
| Comisión de Gestión | 1,25% |
| Valor Liquidativo | \$ 99.35 |
| Patrimonio de Fondo | \$577.32M |
| Número de posiciones | 79 |
| Duración media | 2,07 |
| YTM Media | 5,36% |
| Índice | Composite** |
| Categoría | Mixtos Moderados |
| Entidad gestora | Santander AM Lux |

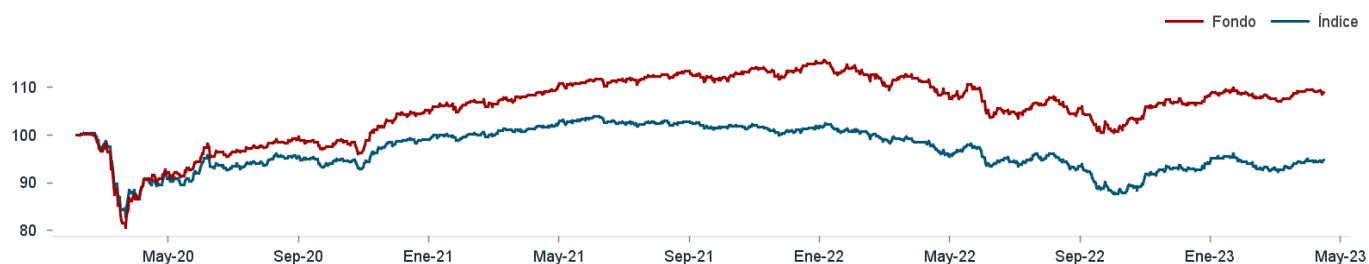
** 60% LF97TRUU INDEX; 35% SPGDAUP INDEX; 5% Cash

Estadísticas*

| | Fondo | Índice |
|----------------------|-------|--------|
| Volatilidad (%) | 6,21 | 5,44 |
| Ratio de Sharpe | 0,76 | 0,04 |
| Ratio de Información | 1,22 | |
| Beta | 0,92 | |
| R ² | 0,65 | |
| Alfa (%) | 4,62 | |
| Alfa de Jensen (%) | 4,54 | |
| Correlación | 0,81 | |
| Ratio de Treynor | 0,05 | |
| Tracking Error (%) | 3,71 | |

* Período de cálculo 3 años. Cálculos con valoraciones diarias.

Rendimiento acumulado desde lanzamiento



Monthly performance (%)¹

| | Ene | Feb | Mar | Abr | May | Jun | Jul | Ago | Sep | Oct | Nov | Dic | Total |
|------|-------|-------|-------|-------|------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2023 | 2,51 | -1,37 | 0,82 | 0,20 | - | - | - | - | - | - | - | - | 2,15 |
| 2022 | -1,11 | -1,10 | -0,11 | -3,44 | 1,61 | -5,01 | 2,04 | -2,06 | -3,85 | 2,70 | 3,81 | -0,52 | -7,20 |
| 2021 | -0,22 | 0,92 | 1,76 | 1,39 | 1,60 | 0,28 | 0,81 | 0,91 | -1,78 | 1,77 | -1,25 | 2,81 | 9,28 |
| 2020 | - | - | -9,32 | 5,30 | 2,37 | 1,81 | 1,36 | 1,68 | -1,42 | -1,36 | 6,44 | 2,57 | 5,12 |
| 2019 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 2018 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

¹ Cálculos netos de comisiones.

Política de inversión

El objetivo de inversión es crear una cartera diversificada de valores emitidos por empresas, o por gobiernos, establecidos, cotizados o negociados en todo el mundo. Invertirá, directa o indirectamente, a través de fondos de inversión de terceros, en valores de renta fija y títulos de renta variable de emisores públicos o privados europeos o norteamericanos, pero sin excluir inversiones en otros miembros de la OCDE y países emergentes. En circunstancias normales, la exposición a renta variable no excederá el 65%.

Rentabilidad Acumulada (%)

| | 1M | 3M | 6M | YTD | 1Y | Lanzam.* |
|--------|------|-------|------|-------|------|----------|
| Fondo | 0,20 | -0,35 | 5,49 | 2,15 | 0,48 | 2,68 |
| Índice | 0,87 | -0,58 | 6,48 | -1,78 | 2,32 | -1,57 |

Rentabilidad anualizada*

Rentabilidad Anual (%)

| | 2023 | 2022 | 2021 | 2020* | 2019 | 2018 |
|--------|------|-------|------|-------|------|------|
| Fondo | 2,15 | -7,20 | 9,28 | 5,12 | - | - |
| Índice | 2,32 | -8,69 | 2,53 | -0,99 | - | - |

* Desde inicio.

Volatilidad anual (%)

| | 2023 | 2022 | 2021 | 2020* | 2019 | 2018 |
|--------|------|------|------|-------|------|------|
| Fondo | 3,74 | 7,45 | 4,62 | 12,54 | - | - |
| Índice | 4,82 | 6,37 | 3,25 | 15,30 | - | - |

* Desde inicio.

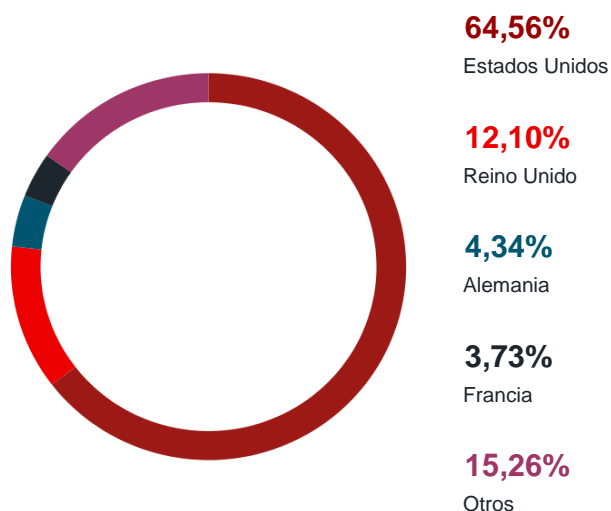
Distribución de cartera

| 10 principales posiciones (%) | 30,23 |
|---|-------|
| M&G (LUX) Investment Funds 1 SICAV - M&G (Lux) Global Floating Rate I | 5,32 |
| IShares USD Short Duration High Yield Corp Bond UCITS ETF | 4,32 |
| Government Of The United States Of America 0.0% 07-sep-2023 | 4,08 |
| AbbVie, Inc. | 3,08 |
| Government Of The United States Of America 0.0% 10-aug-2023 | 2,47 |
| GAM Star Fund PLC - GAM Star MBS Total Return Institutional Class USD | 2,44 |
| NEUBERGER BERMAN SHORT DURATION EMERGING MARKET | 2,32 |
| American Express Company 2.5% 30-jul-2024 | 2,19 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 3.0% 15-mar-2024 | 2,04 |
| Citigroup Inc. | 1,96 |

| Duración (%) | |
|-------------------------------------|-------|
| Effective Duration Bin 5: 1.0 - 3.0 | 31,86 |
| Effective Duration Bin 6: 0.0 - 1.0 | 11,96 |
| Effective Duration Bin 4: 3.0 - 5.0 | 10,36 |
| Effective Duration Bin 3: 5.0 - 7.0 | 2,16 |
| Effective Duration Bin 7: < 0.0 | 2,09 |
| Effective Duration Bin 1: > 10.0 | 0,65 |

| Yield to maturity (%) | |
|------------------------------------|-------|
| Yield to Maturity Bin 1: > 5.0 | 32,15 |
| Yield to Maturity Bin 2: 3.0 - 5.0 | 26,94 |

Distribución geográfica - Renta fija



| Asset allocation (%) | |
|----------------------|-------|
| Renta Fija | 59,09 |
| Renta Variable | 21,02 |
| Fondos | 16,19 |
| Derivados | -0,13 |
| Efectivo | 3,84 |

| Divisa (%) | |
|------------|-------|
| USD | 97,59 |
| CHF | 1,29 |
| GBP | 1,10 |
| EUR | 0,01 |

El propósito de este documento es proporcionar información que resuma las características principales del producto y bajo ninguna circunstancia constituye un acuerdo contractual, una recomendación, asesoramiento personalizado, una oferta o una captación. Esta comunicación es material de promoción comercial.

Se recomienda consultar el Folleto y el KIID (Documento de datos fundamentales para el inversor) antes de tomar una decisión de inversión, suscribir o comprar acciones o reembolsar inversiones, junto con la lista de países en los que el producto está registrado para la venta, disponible en www.santanderassetmanagement.lu o a través de intermediarios autorizados en su país de residencia. No se ha comprobado que los datos contenidos en este documento cumplan los requisitos de comercialización de todos los países de venta. El producto descrito en este documento puede no ser apto para su venta o distribución en ciertas jurisdicciones o para ciertas categorías o tipos de inversores. Este producto no puede ofrecerse ni venderse directa o indirectamente a, o en beneficio de, un ciudadano de los Estados Unidos de acuerdo con la normativa de la FATCA (Ley de cumplimiento tributario de cuentas extranjeras), en línea con las restricciones de venta establecidas en el folleto del fondo.

Este fondo tiene un folleto redactado en inglés que se puede obtener en www.santanderassetmanagement.lu

Para obtener información sobre el producto, póngase en contacto con Santander Asset Management Luxembourg S.A. (43, Avenue John F.Kennedy L-1855 Luxemburgo - Gran Ducado de Luxemburgo), sociedad gestora del fondo bajo la supervisión de la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). El depositario y administrador del fondo es JP Morgan SE, Luxembourg Branch (6, route de Treves, L-2633 Senningerberg - Gran Ducado de Luxemburgo).

La inversión en fondos de inversión puede estar sujeta a riesgos de inversión, incluidos, entre otros, riesgo de mercado, riesgo de crédito, riesgo de emisor y contraparte, riesgo de liquidez, riesgo de divisas y, cuando proceda, riesgos relativos a mercados emergentes. Además, si los fondos mantienen inversiones en fondos de inversión libre, activos, fondos inmobiliarios, materias primas y capital riesgo, debe tenerse en cuenta que estos pueden estar sujetos a riesgos operativos y de valoración inherentes a este tipo de activos y mercados, así como al riesgo de fraude o riesgo derivado de la inversión en mercados no regulados o no supervisados o activos no cotizados.

La rentabilidad histórica no es indicativa de los resultados futuros. Las rentabilidades se calculan sobre la base del valor liquidativo, netas de comisiones, y se anualizan para períodos superiores a un año.

Antes de invertir en el fondo, es aconsejable que el inversor busque asesoramiento personalizado sobre tributación, ya que depende de las circunstancias individuales de cada inversor y puede cambiar en el futuro.

Los inversores pueden obtener un resumen de los derechos de los inversores en www.santanderassetmanagement.lu

La información contenida en este documento se considera fiable, pero Santander Asset Management Luxembourg S.A. no garantiza su integridad ni exactitud.

www.santanderassetmanagement.lu Alemania | Argentina | Brasil | Chile | España | Luxemburgo | México | Polonia | Portugal | Puerto Rico | Reino Unido