

SANTANDER GO ABSOLUTE RETURN RKP

Febrero 2023

Información general

Gestor	Amundi
ISIN	LU1980187832
Fecha de lanzamiento	29/01/2021
Divisa de Clase	GBP
Aportación Mínima	500,00 £
Comisión de Gestión	0,60%
Valor Liquidativo	£ 92.82
Patrimonio de Fondo	€417.30M
Número de posiciones	1403
Duración media	5,07
YTM Media	4,81%
Índice	-
Categoría	Retorno Absoluto
Entidad gestora	Santander AM Lux

* La divisa del fondo es EUR y esto puede conllevar incrementos o disminuciones del capital invertido en función de las fluctuaciones del

Estadísticas*

	Fondo	Índice
Volatilidad (%)	7,13	-
Ratio de Sharpe	13,64	-
Ratio de Información	-	-
Beta	-	-
R ²	-	-
Alfa (%)	-	-
Alfa de Jensen (%)	-	-
Correlación	-	-
Ratio de Treynor	-	-
Tracking Error (%)	-	-

* Período de cálculo 2 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	1,39	-3,13	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-1,78
2022	-1,60	-0,36	2,06	-0,56	0,02	-1,09	-3,02	1,43	1,18	-1,98	0,93	2,27	-0,88
2021	-	-1,68	-1,81	2,03	-0,91	-0,36	0,06	0,97	-0,56	-1,30	-0,10	-0,85	-4,49
2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

¹ Cálculos netos de comisiones.

Política de inversión

El Subfondo busca lograr un rendimiento positivo a medio plazo, independientemente de las condiciones del mercado. El Subfondo invierte, directa o indirectamente, en una amplia gama de activos tales como, pero no limitados a, bonos gubernamentales y corporativos de cualquier vencimiento, acciones, bonos convertibles, valores del mercado monetario, materias primas y divisas. Los activos estarán denominados principalmente en EUR, USD, JPY o en otras monedas europeas.

Rentabilidad Acumulada (%)

	1M	3M	6M	YTD	1Y Lanzam.*	
Fondo	-3,13	0,44	0,54	-1,78	-0,70	-3,31
Índice						

Rentabilidad anualizada*

Rentabilidad Anual (%)

	2023	2022	2021*	2020	2019	2018
Fondo	-1,78	-0,88	-4,49	-	-	-
Índice						

* Desde inicio.

Volatilidad anual (%)

	2023	2022	2021*	2020	2019	2018
Fondo	8,15	8,39	5,16	-	-	-
Índice						

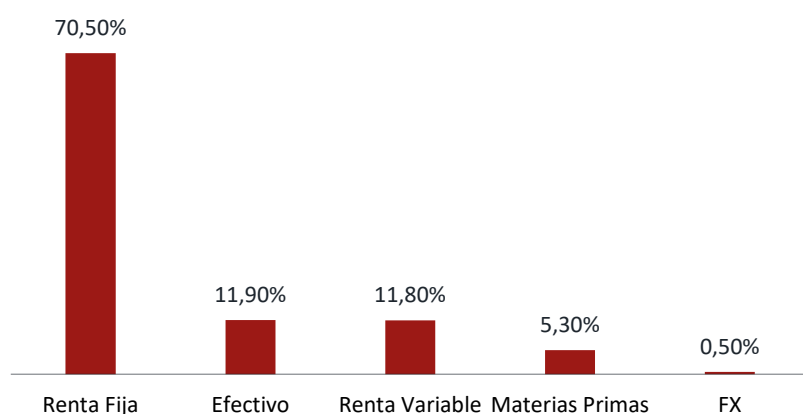
* Desde inicio.

Distribución de cartera

Principales posiciones en cartera		26,39%
1	BTPS % 04/24 3Y	4,61%
2	US TSY 2% 11/41	3,79%
3	DBRI IE 0.1% 4/26	3,76%
4	US TSY 1.875% 02/41	3,24%
5	AMUNDI PHYSICAL GOLD ETC (AMSTERDAM)	2,97%
6	BTPS IT 0.45% 05/23	2,24%
7	OAT 1.75% 5/23	1,70%
8	SWISS 1.25% 5/26	1,49%
9	AMUNDI BBG EQUAL WEIGHT COMMEXAGR (LSE)	1,40%
10	EIB % 05/23 EARN	1,19%

Exposición principal de divisas	
USD	11,75%
JPY	2,77%
DKK	2,28%
CHF	2,12%
MXN	1,74%
GBP	1,61%
CAD	1,33%
BRL	1,12%
HUF	1,12%
Otros	-3,44%

Distribución de Activos



Renta Fija	70,50%
Efectivo	11,90%
Renta Variable	11,80%
Materias Primas	5,30%
FX	0,50%

Distribución de cartera - Renta Variable

Distribución Geográfica	11,8%
Unión Europea	5,4%
Norte América	4,1%
Europa ex-UE	1,4%
Japón	0,7%
Emergentes	0,2%
Asia ex-Japón	0,1%
#N/D	0,0%
#N/D	0,0%

Distribución Sectorial	11,8%
Industriales	2,3%
Financieras	1,9%
Consumo Discrecional	1,8%
Tecnología de la información	1,3%
Materiales	0,4%
Cuidado de la salud	0,4%
Servicios de Comunicación	0,3%
Consumo Básico	0,2%
Utilities	0,1%
Inmobiliario	0,1%
ETFs	2,9%
Derivados	0,2%

Distribución de cartera - Renta Fija

Distribución Geográfica	70,5%
Unión Europea	36,9%
Europa ex-UE	11,3%
Norte América	9,2%
Emergentes	7,4%
Otros	3,3%
Japón	1,3%

Vencimientos	70,5%
<1	22,6%
1-3	15,1%
3-7	8,2%
7-15	6,4%
15-25	9,8%
25+	8,5%
Variable	0,1%
Otros	0,0%

Rating	70,5%
AAA	22,0%
AA+	0,4%
AA	2,5%
AA-	0,9%
A+	0,9%
A	1,1%
A-	3,3%
BBB+	2,7%
BBB	15,9%
BBB-	5,4%
BB+	4,4%
BB	3,6%
BB-	2,8%
B+	1,9%
B	2,0%
B-	0,6%
CCC+	0,5%
CCC	0,2%
NR	0,7%
Otros	-1,1%

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. (19, rue de Bitbourg L-1273 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 periodos 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. Santander Asset Management Luxembourg S.A. no asume ninguna responsabilidad por el uso de la información contenida en el presente documento.

© Santander Asset Management Luxembourg S.A. Todos los derechos reservados