

SANTANDER GO DYNAMIC BOND RKP

Febrero 2023

Información general

| | |
|----------------------|------------------|
| Gestor | PIMCO |
| ISIN | LU2013632257 |
| Fecha de lanzamiento | 29/01/2021 |
| Divisa de Clase | GBP |
| Aportación Mínima | 10.000,00 £ |
| Comisión de Gestión | 0,60% |
| Valor Liquidativo | £ 103.65 |
| Patrimonio de Fondo | \$133.28M |
| Número de posiciones | 471 |
| Duración Media | 3,55 |
| YTM Media | 5,75% |
| Índice | - |
| Categoría | |
| Entidad gestora | Santander AM Lux |

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

Estadísticas*

| | Fondo | Índice |
|----------------------|-------|--------|
| Volatilidad (%) | 9,59 | - |
| Ratio de Sharpe | 10,73 | - |
| Ratio de Información | - | - |
| Beta | - | - |
| R ² | - | - |
| Alfa (%) | - | - |
| Alfa de Jensen (%) | - | - |
| Correlación | - | - |
| Ratio de Treynor | - | - |
| Tracking Error (%) | - | - |

* Periodo de cálculo 2 años. Cálculos con valoraciones diarias.

Rendimiento acumulado desde lanzamiento



Rentabilidad mensual (%)¹

| | Ene | Feb | Mar | Abr | May | Jun | Jul | Ago | Sep | Oct | Nov | Dic | Total |
|------|-------|-------|------|------|-------|------|-------|------|------|-------|-------|-------|-------------|
| 2023 | -0,64 | 1,00 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,35 |
| 2022 | -0,47 | -1,17 | 0,14 | 2,50 | -0,06 | 0,52 | 1,80 | 3,05 | 1,74 | -2,88 | -2,12 | -0,74 | 2,17 |
| 2021 | - | -2,03 | 1,35 | 0,02 | -2,23 | 2,60 | -0,42 | 1,05 | 1,72 | -2,44 | 3,32 | -1,59 | 1,16 |
| 2020 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| 2019 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| 2018 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |

¹ Cálculos netos de comisiones.

Política de inversión

El objetivo de inversión del SubFondo es buscar la máxima rentabilidad a largo plazo y preservar el capital. El Subfondo pretende invertir al menos dos tercios de sus activos en una cartera diversificada de instrumentos de renta fija de distintos vencimientos.

Rentabilidad acumulada (%)¹

| | 1M | 3M | 6M | YTD | 1Y | Lanzam.* |
|---------------|------|-------|-------|------|------|----------|
| Fondo | 1,00 | -0,39 | -3,65 | 0,35 | 4,23 | 1,77 |
| Índice | | | | | | |

Rentabilidad anualizada*

Rentabilidad anual (%)¹

| | 2023 | 2022 | 2021* | 2020 | 2019 | 2018 |
|---------------|------|------|-------|------|------|------|
| Fondo | 0,35 | 2,17 | 1,16 | - | - | - |
| Índice | | | | | | |

* Desde inicio.

Volatilidad anual (%)¹

| | 2023 | 2022 | 2021* | 2020 | 2019 | 2018 |
|---------------|------|-------|-------|------|------|------|
| Fondo | 9,74 | 11,56 | 6,56 | - | - | - |
| Índice | | | | | | |

* Desde inicio.

Distribución de cartera

Top 10 holdings (%)

| | |
|---------------------------------------|-----|
| IRS EUR 0.50000 02/09/23-1Y (WHT) LCH | 27% |
| IRS USD 1.27000 11/04/22-1Y (WHT) LCH | 20% |
| U S TREASURY REPO | 11% |
| FIN FUT US 2YR CBT 06/30/23 | 10% |
| PIMCO USD (4749) ST FLT NAV FUND | 10% |
| IRO EUR 1Y P 2.10000 L 03/31/23 BPS | 8% |
| IRS NZD 3.00000 12/15/22-1Y (WHT) LCH | 7% |
| U S TREASURY BILLS | 7% |
| JAPAN TREASURY DISC BILL #1132 | 6% |
| IRS KRW 1.75000 12/15/21-5Y LCH | 6% |

*Posiciones cortas en valor absoluto

Vencimientos (%)

| | |
|------------|-------|
| 0-1 años | 33,2% |
| 1-3 años | 33,2% |
| 3-5 años | 5,5% |
| 5-10 años | 24,0% |
| 10-20 años | 8,5% |
| 20+ años | -4,4% |

Exposición a divisas (%)

| | |
|-----|--------|
| USD | 99,09% |
| EUR | -1,77% |
| JPY | 1,32% |
| ZAR | 0,64% |
| AUD | 0,46% |
| GBP | 0,44% |
| BRL | 0,38% |
| MXN | 0,24% |
| PEN | -0,20% |
| COP | 0,10% |

Distribución Sectorial (%)

| | |
|--|-------|
| Otros Instrumentos Netos de Corta Duración | 31,2% |
| Titulizado | 25,0% |
| Crédito de grado de inversión | 17,6% |
| Relacionado con el gobierno US | 8,5% |
| Desarrollados no US | 6,7% |
| Crédito High Yield | 5,2% |
| Mercados emergentes | 5,0% |
| Otros | 0,8% |

Rating (%)

| | |
|------------------|-------|
| A1/P1 | 13,8% |
| Inferior a A1/P1 | 0,8% |
| AAA | 24,2% |
| AA | 11,6% |
| A | 6,0% |
| BBB | 18,9% |
| BB | 8,3% |
| B | 6,4% |
| Inferior a B | 9,8% |

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.