31 de mayo de 2022

Sabadell Asset Management

Comunicación Publicitaria

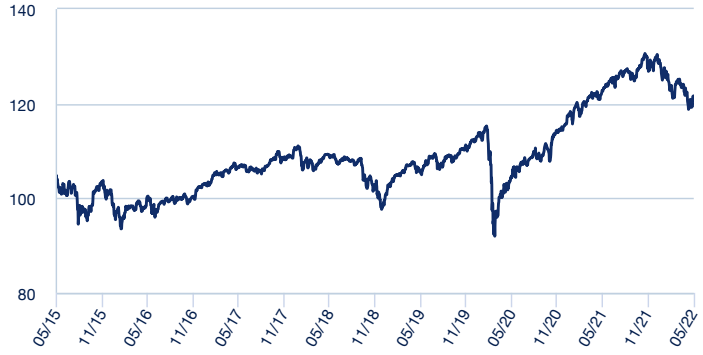
# SABADELL EQUILIBRADO, F.I. - PREMIER

a company of Amundi

## POLÍTICA DE INVERSIÓN

El Fondo ofrece una solución de inversión con Asset Allocation activo incorporado, instrumentada como Fondo de Fondos, cuyo objetivo es maximizar la rentabilidad, sin superar una volatilidad propia de un perfil de riesgo equilibrado. El Fondo invertirá más del 50% del patrimonio en IIC financieras aptas, armonizadas o no, de gestión tradicional o de gestión alternativa y pertenecientes o no al grupo de la Gestora. El Fondo de Fondos invertirá de forma significativa en otros Fondos de Sabadell Asset Management. La posición en renta variable se gestionará activamente en función de las expectativas, situándose entre el 25% y el 75% del patrimonio. El Fondo de Fondos también tomará posiciones, con un límite del 25% de su patrimonio, en otros Fondos especializados en materias primas. Se puede obtener una descripción más completa de la política de inversión en el documento de datos fundamentales para el inversor (DFI) disponible en www.sabadellassetmanagement.com.

## EVOLUCIÓN DEL VALOR LIQUIDATIVO




## DATOS DEL FONDO

| | |
|---|---|
| **Vocación** | GLOBAL |
| **Permanencia mínima recomendada** | 4 años |
| **Fecha constitución** | 13/01/2015 |
| **Patrimonio** | 779 474 827,79 |
| **Divisa de denominación del fondo** | EUR |
| **Indicador de Riesgo y Rentabilidad** | 1 2 3 4 **5** 6 7 |

## DATOS DE LA CLASE

| | |
|---|---|
| **Comisión de gestión** | 0,65% |
| **Inversión mínima** | 1 000 000 € |
| **ISIN** | ES0174436032 |
| **Fecha creación** | 06/02/2015 |
| **Comisión de depositaria** | 0,05% |

## INVERSIÓN EN CARTERA

| | |
|---|---|
| **Número de posiciones** | 110 |

### Principales posiciones

#### Sabadell Asset Management

| | |
|---|---|
| PART.SABADELL EEUU BOL CARTERA. FI | 9,11% |
| PART.SABADELL INTERES EURO CART. FI | 7,53% |
| PART.SABADELL EUROPA BOLSA ESG, FI-CART | 5,71% |

#### Otras gestoras

| | |
|---|---|
| PART.AMUNDI EURO LIQUIDITY RATED SRI -I | 3,69% |
| AC.PIMCO GIS-COM REAL RE-IEURUA | 2,99% |
| AC.ELEVA EUROPEAN SELECTION FD-I2 | 2,40% |

### Exposición por categorías de activo

| | |
|---|---|
| **Renta Variable** | 45,52% |
| **Renta Fija** | 27,16% |
| **Gestión Alternativa** | 9,89% |
| **Commodities** | 4,13% |
| **Monetarios** | 7,85% |

## RENTABILIDADES

### Rentabilidades anuales

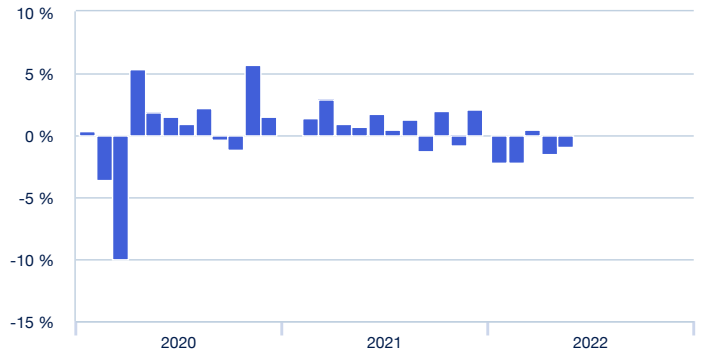
| | |
|---|---|
| **2012** | - |
| **2013** | - |
| **2014** | - |
| **2015** | - |
| **2016** | 0,45% |
| **2017** | 6,15% |
| **2018** | -8,85% |
| **2019** | 13,12% |
| **2020** | 3,40% |
| **2021** | 11,91% |

### Rentabilidades acumuladas

| | |
|---|---|
| **año actual** | -6,28% |
| **1 mes** | -0,94% |
| **3 meses** | -2,02% |
| **6 meses** | -4,32% |
| **12 meses** | -1,08% |

La rentabilidad registrada en el pasado no es ninguna garantía para el futuro.

## RENTABILIDADES MENSUALES (Últimos 36 meses)




## ESTADÍSTICAS (Últimos 36 meses)

### Rentabilidad

| | |
|---|---|
| **% Meses rentabilidad positiva** | 69,44% |
| **Rentabilidad mejor mes** | 5,75% |
| **Rentabilidad peor mes** | -10,04% |

### Riesgo

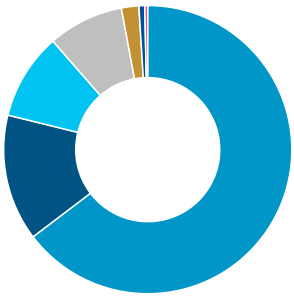
| | |
|---|---|
| **Volatilidad del fondo** | 9,30% |
| **Ratio de Sharpe** | 0,58 |

# Resumen de posiciones

## Renta Fija

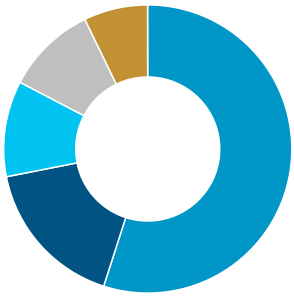
### Distribución por áreas geográficas de la Renta Fija

- Zona Euro: 64,66%
- Norteamérica: 14,20%
- Mercados Emergentes: 9,70%
- Europa ex-UEM: 8,50%
- Japón: 1,95%
- Otros: 0,65%
- Asia ex-Japón: 0,32%



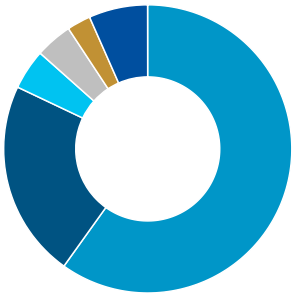
### Distribución por emisores

- Renta Fija Privada: 54,96%
- Soberanos: 16,95%
- Cuasi-soberanos: 10,75%
- Titulizado: 10,15%
- Otros: 7,19%



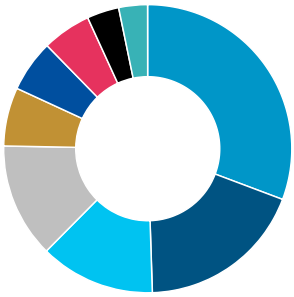
### Distribución por divisas del fondo

- EUR: 59,89%
- USD: 22,16%
- JPY: 4,53%
- AUD: 4,15%
- GBP: 2,66%
- Otros: 6,61%



### Distribución por estrategias alternativa

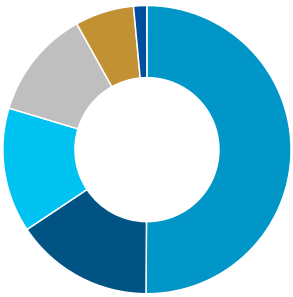
- Multiestrategia: 30,73%
- Long Short Equity: 18,76%
- Event Driven: 12,94%
- Equity Market Neutral: 12,88%
- L/S Credit: 6,57%
- Global Macro: 5,81%
- Otros: 5,48%
- Fixed Income Absolute Return: 3,60%
- Event Driven - Special Sits: 3,23%



## Renta Variable

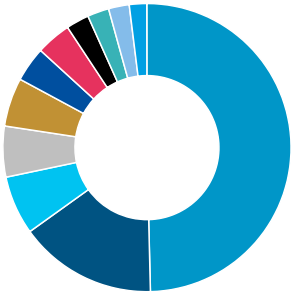
### Distribución por áreas geográficas de la Renta Variable

- Norteamérica: 50,11%
- Zona Euro: 15,55%
- Europa ex-UEM: 13,99%
- Mercados Emergentes: 12,26%
- Japón: 6,61%
- Asia ex-Japón: 1,48%



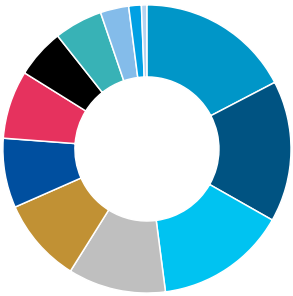
### Distribución por países

- Estados Unidos: 49,62%
- Otros: 15,49%
- Japón: 6,61%
- Suiza: 5,69%
- Reino Unido: 5,47%
- China: 3,92%
- Francia: 3,92%
- España: 2,59%
- Holanda: 2,42%
- Italia: 2,31%
- Taiwán: 1,97%



### Distribución por sectores

- Tecnología: 17,37%
- Salud: 15,85%
- Finanzas: 14,74%
- Industria: 10,96%
- Consumo Discrecional: 9,49%
- Consumo no cíclico: 7,79%
- Servicios de Comunicación: 7,66%
- Materiales: 5,51%
- Energía: 5,43%
- Servicios públicos: 3,19%
- Inmobiliario: 1,41%
- Otros: 0,61%



Este documento no constituye una oferta o recomendación para la adquisición o venta, o para realizar cualquier otra transacción. Ninguna información contenida en el presente informe debe interpretarse como asesoramiento o consejo. Las decisiones de inversión o desinversión en el Fondo deberán ser tomadas por el inversor de conformidad con los documentos informativos previstos por la normativa vigente. Las inversiones están sujetas a las fluctuaciones del mercado y otros riesgos inherentes a la inversión en valores y en otros instrumentos financieros, por lo que el valor de adquisición del Fondo y las rentabilidades obtenidas pueden experimentar variaciones tanto al alza como a la baja y cabe la posibilidad que un inversor no recupere el importe invertido inicialmente. Todos los documentos informativos del Fondo se pueden consultar en sabadellassetmanagement.com. Fuente: Sabadell Asset Management.