

Información del fondo

Denominación social

Annual Cycles Strategies, FI

Política de inversión

Categoría (Circular 3/2011 de CNMV) Global
Índice de referencia No tiene

Datos claves

Valor liquidativo 14,59 €
Patrimonio neto 12.057.099,90 €
Cálculo del valor liquidativo Diario
Divisa de denominación EUR
Dividendos Acumulación

Características administrativas

Forma legal Fondo de Inversión de derecho español (UCITS IV)
Órgano supervisor CNMV
Nº Registro 4269
Sociedad Gestora Gesiuris Asset Management, SGIIC, SA.
Gestor Albert Parès Hereu
Asesor
Depositario Banco Inversis, SA
Auditor Deloitte, S.L.
Fecha de constitución 04/10/10
Fecha de registro 25/10/10
Fecha inicio política de inversión actual 25/10/10
Inversión mínima
Comisión de gestión s/patrimonio 1%
Comisión de gestión s/resultados No tiene
Comisión de depositaria Sobre patrim. por tramos acumulativos:
0€ - 5.000.000,00€ 0,08%
5.000.000,01€ - 10.000.000,00€ 0,075%
10.000.000,01€ - 25.000.000,00€ 0,07%
25.000.000,01€ - En adelante 0,065%
Comisión de suscripción No tiene
Comisión de reembolso No tiene
TER (año anterior) 1,14%

Información comercial

Código ISIN ES0109298002
Código Bloomberg ANNSTRA SM EQUITY
Mercado de cotización -

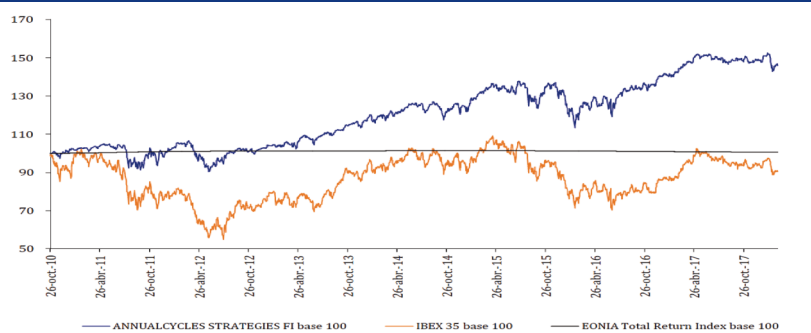
Estrategia de inversión

Es un fondo mixto, flexible y global, que está invertido en activos de máxima calidad. En situaciones normales, el Fondo estará invertido en un 45% en Renta Variable y en un 45% en Renta Fija. El Fondo utilizará el ciclo anual para modular la exposición de riesgo de mercado (de 0% a 100%), la rotación de la cartera y el momento para la venta de opciones.

Rentabilidades acumuladas

	1 mes	6 meses	Año actual	1 año	3 años	5 años	10 años	Inicio de la gestión
ANNUALCYCLES STRATEGIES FI	-3,10%	-1,21%	-1,10%	2,13%	10,52%	39,88%		46,08%
IBEX 35	-5,85%	-4,46%	-2,03%	2,98%	-11,97%	19,56%		-9,48%
EONIA Total Return Index	-0,03%	-0,18%	-0,06%	-0,36%	-0,84%	-0,67%		0,56%

Evolución desde registro a CNMV o cambio de política de inversión



Indicadores de riesgo

		1 año	3 años	5 años	10 años	Inicio de la gestión
Volatilidad anualizada	ANNUALCYCLES STRATEGIES	6,48%	11,14%	10,04%		10,77%
	IBEX 35	13,50%	20,18%	19,50%		22,18%
	EONIA Total Return	0,01%	0,01%	0,02%		0,03%
Ratio Sharpe anualizado*	ANNUALCYCLES STRATEGIES	0,51	0,33	0,70		0,45
	IBEX 35	0,31	NA	0,19		NA
	EONIA Total Return	57,49	NA	NA		NA
Alpha de Jensen anualizada*	IBEX 35	1,53%	5,63%	5,26%		5,59%
	EONIA Total Return	31,39%	3,63%	7,92%		1,17%
Beta	IBEX 35	0,42	0,51	0,47		0,42
	EONIA Total Return	-35,46	-4,03	9,67		-9,25
Coef. Correlación	IBEX 35	88,33%	91,70%	90,60%		86,85%
	EONIA Total Return	-7,55%	-0,48%	1,53%		-2,51%
Tracking Error anualizado	IBEX 35	8,35%	10,91%	11,24%		13,89%
	EONIA Total Return	6,48%	11,14%	10,03%		10,77%
Ratio Información anualizado	IBEX 35	-0,18	0,55	0,15		0,32
	EONIA Total Return	0,40	0,37	0,72		0,51
Rentabilidad anualizada activo libre de riesgo*	2017	-1,15%	-0,27%	-0,04%		0,47%
	2016		2016			
Rotación de la cartera		0	0,04			

*Activo libre de riesgo: Bloomberg/EFFAS Bond Indices Germany Govt 1-3 Yr TR

*Anualización = 252 días

Resumen de exposición de riesgos sobre patrimonio

	Inversión Directa	Inversión IICs	Inversión Derivados	Exposición Neta
Renta Variable	44,11%		25,72%	69,83%
Renta Fija	8,73%			8,73%
Inversión alternativa		2,77%		2,77%

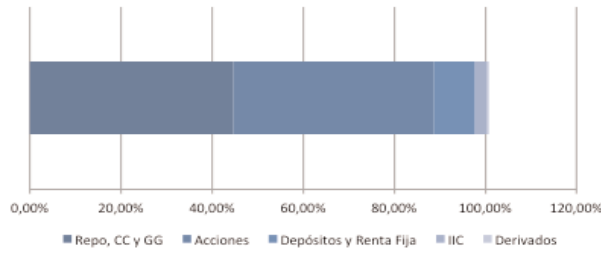
Rentabilidades mensuales

		12	11	10	9	8	7	6	5	4	3	2	1	Anuales
2018	ANNUALCYCLES STRATEGIES FI													
	IBEX 35													
	EONIA Total Return Index													
2017	ANNUALCYCLES STRATEGIES FI	-0,42%	-1,71%	0,71%	1,34%	-0,82%	0,14%	-1,23%	0,16%	1,66%	3,49%	2,22%	-0,26%	5,29%
	IBEX 35	-1,64%	-2,97%	1,37%	0,80%	-1,93%	0,55%	-4,00%	1,53%	2,42%	9,50%	2,58%	-0,39%	7,40%
	EONIA Total Return Index	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,36%
2016	ANNUALCYCLES STRATEGIES FI	3,06%	0,37%	1,04%	0,88%	0,91%	5,47%	-3,61%	1,89%	1,51%	3,26%	-1,80%	-6,47%	6,12%
	IBEX 35	7,64%	-4,98%	4,14%	0,72%	1,51%	5,19%	-9,64%	0,09%	3,47%	3,09%	-4,02%	-7,63%	-2,01%
	EONIA Total Return Index	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,03%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,32%
2015	ANNUALCYCLES STRATEGIES FI	-3,38%	1,39%	7,76%	-3,53%	-4,48%	2,89%	-1,26%	-0,05%	-0,23%	1,49%	3,40%	2,89%	6,40%
	IBEX 35	-8,11%	0,25%	8,38%	-6,81%	-8,24%	3,82%	-3,99%	-1,47%	-1,18%	3,07%	7,45%	1,20%	-7,15%
	EONIA Total Return Index	-0,02%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,61%
2014	ANNUALCYCLES STRATEGIES FI	-1,44%	2,04%	-0,87%	-0,69%	1,40%	-1,37%	1,16%	1,72%	0,79%	0,85%	2,02%	0,03%	5,17%
	IBEX 35	-4,56%	2,80%	-3,21%	0,90%	0,20%	-1,98%	1,16%	3,25%	1,15%	2,24%	1,96%	0,04%	3,66%
	EONIA Total Return Index	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,02%	0,02%	0,02%	0,01%	0,02%	0,10%
2013	ANNUALCYCLES STRATEGIES FI	0,72%	1,27%	3,05%	2,35%	-0,41%	2,59%	-1,29%	1,63%	2,09%	0,03%	0,63%	0,69%	14,09%
	IBEX 35	0,80%	-0,71%	7,86%	10,80%	-1,69%	8,64%	-6,71%	-1,17%	6,30%	-3,77%	-1,58%	2,39%	21,42%
	EONIA Total Return Index	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,09%
2012	ANNUALCYCLES STRATEGIES FI	0,94%	0,82%	-0,16%	1,05%	1,70%	2,53%	4,89%	-7,12%	-4,70%	-1,30%	1,87%	2,32%	2,24%
	IBEX 35	2,94%	1,17%	1,74%	3,88%	10,13%	-5,13%	16,62%	-13,14%	-12,45%	-5,41%	-0,51%	-0,67%	-4,66%
	EONIA Total Return Index	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,02%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,04%	0,24%

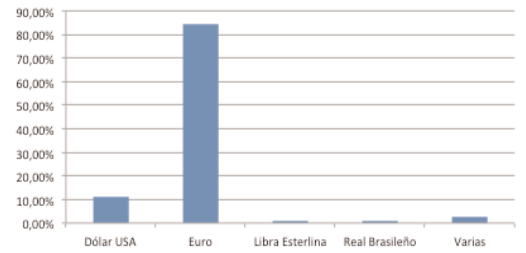
Todos los datos han sido recogidos el último día hábil de mes al que hace referencia la ficha.

Visión general de la cartera

Efectivo sobre patrimonio

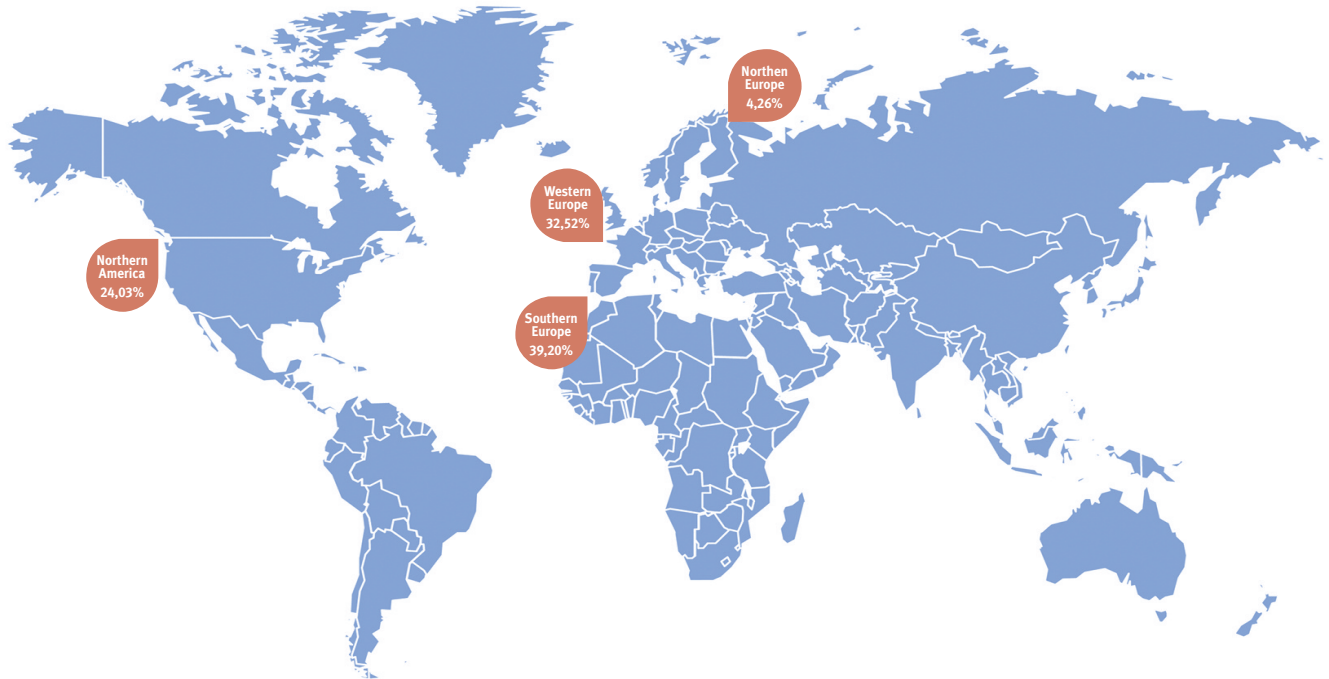


Riesgo divisa sobre patrimonio

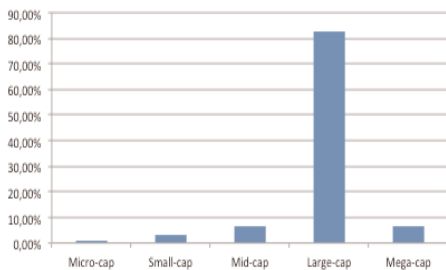


Cartera de acciones

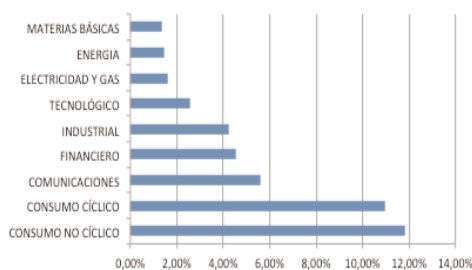
Distribución de la cartera de acciones por sub-región sobre patrimonio



Distribución de la Renta Variable por capitalización bursátil



Distribución de la cartera de acciones por sector sobre patrimonio

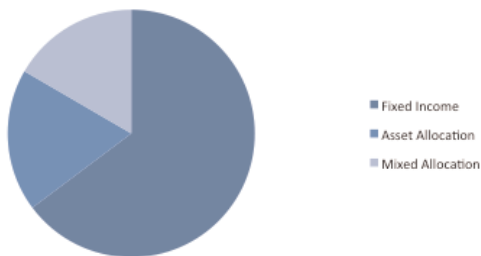


Cinco mayores posiciones de la cartera de acciones sobre patrimonio

ALPHABET INC - CLASS A	3,31%
GRIFOLS SA - CLASE B	3,09%
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,88%
ADIDAS AG	1,82%
BANCO SANTANDER SA	1,58%

Cartera de IICs

Distribución de la cartera de IICs por política de inversión sobre patrimonio



Aviso legal: Este documento, así como los datos, opiniones y estimaciones contenidas en el mismo, han sido elaborados por GESIURIS ASSET MANAGEMENT, S.G.I.I.C., S.A. (en adelante, "GESIURIS") con la finalidad de proporcionar a sus clientes información general a la fecha de emisión del mismo, obtenida de fuentes consideradas fidedignas por GESIURIS. Debido al contenido meramente informativo de este documento, el mismo no puede tomarse en consideración para la toma de decisiones. Se debe tener en cuenta que rentabilidades pasadas no son garantía de rentabilidades futuras. Rogamos no duden en ponerse en contacto con GESIURIS en el supuesto de precisar cualquier aclaración o información adicional.