

Información del fondo

Denominación social

STRESCB INVESTMENTS, SICAV, S.A.

Política de inversión

Categoría
(Circular 3/2011 de CNMV) Global

Índice de referencia -

Datos claves

Valor liquidativo 2,46 €

Patrimonio neto 33.549.862,13 €

Cálculo del valor liquidativo Diario

Divisa de denominación EUR

Dividendos Acumulación

Características administrativas

Forma legal Sociedad de inversión de capital variable de derecho español (UCITS IV)

Órgano supervisor CNMV

Nº Registro 3598

Sociedad Gestora Gesiuris Asset Management, SGIIC, SA.

Gestor Salvador Alegre Segura

Asesor Santander Securities Services, S.A.

Auditor KPMG AUDITORES, SL

Fecha de constitución 18/09/08

Fecha de registro 12/12/08

Fecha inicio política de inversión actual 12/12/08

Inversión mínima 1 acción

Comisión de gestión s/patrimonio 1,25%

Comisión de gestión s/resultados 5,00% HWM

Comisión de depositaria

Aplicación por tramos según patrimonio:

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) 1,35%

Información comercial

Código ISIN ES0176388033

Código Bloomberg S3502 SM EQUITY

Mercado de cotización Mercado Alternativo Bursátil (MAB)

Estrategia de inversión

Strescb Investments invierte hasta un 100% en acciones de mercados europeos y americanos, buscando empresas infravaloradas con gran potencial de revalorización a largo plazo, mediante un análisis exhaustivo de las compañías. La inversión es flexible en cuanto a su exposición por país, sector y capitalización, minimizando el riesgo gracias a su diversificación.

Rentabilidades acumuladas

	1 mes	6 meses	Año actual	1 año	3 años	5 años	10 años	Inicio de la gestión
STRESCB INVESTMENTS SICAV	6,63%	-8,15%	6,63%	-7,02%	15,17%	30,40%	140,59%	145,11%
IBEX-35 Net Return	6,53%	-6,95%	6,53%	-10,40%	13,40%	7,64%	60,56%	52,42%
70% Eurostoxx + 30% S&P 500	6,25%	-7,74%	6,25%	-7,60%	22,40%	33,10%	141,73%	125,22%

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	STRESCB INVESTMENTS	11,35%	10,73%	11,76%	12,89%	12,85%
	IBEX-35 Net Return	13,68%	17,58%	18,79%	22,58%	22,63%
	70%Eurostoxx NR + 30%S&P500 NR	12,73%	13,10%	14,87%	17,94%	18,12%
Ratio Sharpe anualizado*	STRESCB INVESTMENTS	NA	0,49	0,47	0,66	0,65
	IBEX-35 Net Return	NA	0,27	0,09	0,18	0,15
	70%Eurostoxx NR + 30%S&P500 NR	NA	0,57	0,40	0,47	0,41
Alpha de Jensen anualizada*	IBEX-35 Net Return	-0,22%	2,95%	4,74%	7,40%	7,54%
	70%Eurostoxx NR + 30%S&P500 NR	-0,64%	-0,43%	1,10%	5,55%	5,92%
	IBEX-35 Net Return	0,64	0,49	0,52	0,25	0,25
Beta	IBEX-35 Net Return	0,64	0,49	0,52	0,25	0,25
	70%Eurostoxx NR + 30%S&P500 NR	0,83	0,77	0,75	0,34	0,33
	IBEX-35 Net Return	77,58%	80,62%	83,07%	44,65%	44,12%
Coef. Correlación	IBEX-35 Net Return	77,58%	80,62%	83,07%	44,65%	44,12%
	70%Eurostoxx NR + 30%S&P500 NR	93,37%	93,89%	94,29%	47,49%	46,50%
	IBEX-35 Net Return	8,66%	10,96%	11,15%	20,40%	20,51%
Tracking Error anualizado	IBEX-35 Net Return	8,66%	10,96%	11,15%	20,40%	20,51%
	70%Eurostoxx NR + 30%S&P500 NR	4,59%	4,77%	5,45%	16,39%	16,64%
	IBEX-35 Net Return	0,38	-0,04	0,24	0,11	0,14
Ratio Información anualizado	IBEX-35 Net Return	0,38	-0,04	0,24	0,11	0,14
	70%Eurostoxx NR + 30%S&P500 NR	0,09	-0,47	-0,15	-0,05	-0,00
	IBEX-35 Net Return	-0,30%	-0,47%	-0,13%	0,71%	0,85%
Rentabilidad anualizada activo libre de riesgo*	2017	2016				
Rotación de la cartera	0,08	0,23				

*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	90,01%	1,88%		91,89%

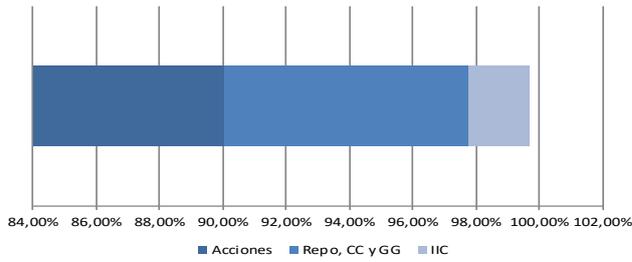
Rentabilidades mensuales

		12	11	10	9	8	7	6	5	4	3	2	1	Anuales	
2019	STRESCB INVESTMENTS SICAV													6,63%	6,63%
	IBEX-35 Net Return													6,53%	6,53%
	70% Eurostoxx NR + 30% S&P 500 NR													6,25%	6,25%
2018	STRESCB INVESTMENTS SICAV	-7,14%	-1,04%	-5,42%	-0,86%	-0,04%	1,46%	-0,07%	1,24%	3,45%	-0,69%	-4,01%	2,27%	-10,83%	
	IBEX-35 Net Return	-5,51%	2,30%	-5,01%	-0,10%	-4,78%	3,09%	2,30%	-5,10%	4,66%	-2,36%	-5,85%	4,42%	-12,17%	
	70% Eurostoxx NR + 30% S&P 500 NR	-6,34%	0,11%	-6,14%	0,36%	-1,68%	3,87%	0,04%	-1,08%	4,17%	-2,27%	-4,30%	3,87%	-9,67%	
2017	STRESCB INVESTMENTS SICAV	0,29%	-0,75%	2,92%	2,91%	-0,50%	-0,55%	-2,34%	0,41%	1,40%	2,75%	2,77%	-0,36%	9,13%	
	IBEX-35 Net Return	-1,28%	-2,93%	1,78%	0,83%	-1,79%	0,81%	-3,48%	1,64%	2,92%	9,54%	2,58%	0,05%	10,51%	
	70% Eurostoxx NR + 30% S&P 500 NR	-0,90%	-1,07%	2,28%	4,21%	-0,43%	0,81%	-1,91%	1,09%	1,68%	3,95%	3,19%	-0,65%	12,69%	
2016	STRESCB INVESTMENTS SICAV	3,62%	1,93%	0,07%	-0,40%	-0,11%	3,46%	-2,34%	1,89%	0,59%	2,15%	-0,21%	-5,05%	5,38%	
	IBEX-35 Net Return	7,92%	-4,65%	4,55%	0,80%	1,51%	5,73%	-9,14%	0,54%	4,04%	3,17%	-3,88%	-7,26%	1,72%	
	70% Eurostoxx NR + 30% S&P 500 NR	6,08%	1,08%	0,75%	-0,40%	0,83%	4,27%	-4,26%	2,25%	1,05%	3,47%	-2,27%	-6,13%	6,23%	
2015	STRESCB INVESTMENTS SICAV	-3,91%	3,52%	9,58%	-3,32%	-5,77%	2,06%	-3,58%	-0,03%	-2,05%	2,16%	6,05%	4,86%	8,72%	
	IBEX-35 Net Return	-7,90%	0,66%	8,60%	-6,78%	-8,15%	4,31%	-3,80%	-1,06%	-0,84%	3,22%	7,45%	1,70%	-4,27%	
	70% Eurostoxx NR + 30% S&P 500 NR	-5,18%	1,97%	9,77%	-4,28%	-8,14%	4,30%	-3,32%	0,30%	-1,01%	1,49%	6,89%	3,72%	5,11%	
2014	STRESCB INVESTMENTS SICAV	-0,56%	2,99%	0,35%	-1,54%	2,70%	-1,40%	0,60%	1,93%	0,25%	0,98%	3,11%	-0,16%	9,50%	
	IBEX-35 Net Return	-4,21%	3,22%	-2,90%	1,01%	0,21%	-1,23%	1,33%	3,67%	1,50%	2,45%	1,96%	0,59%	7,56%	
	70% Eurostoxx NR + 30% S&P 500 NR	-2,21%	3,98%	-1,64%	0,83%	2,49%	-2,78%	0,39%	2,58%	1,29%	0,61%	4,51%	-3,05%	6,85%	
2013	STRESCB INVESTMENTS SICAV	0,14%	1,82%	3,04%	2,86%	-1,05%	3,68%	-2,31%	1,13%	0,43%	1,11%	2,31%	1,69%	15,73%	
	IBEX-35 Net Return	1,02%	-0,28%	8,24%	10,94%	-1,69%	9,84%	-6,51%	-1,02%	6,96%	-3,73%	-1,58%	3,20%	26,39%	
	70% Eurostoxx NR + 30% S&P 500 NR	1,32%	1,45%	5,66%	5,45%	-2,05%	6,10%	-4,51%	2,97%	3,42%	0,90%	-1,38%	3,50%	24,68%	

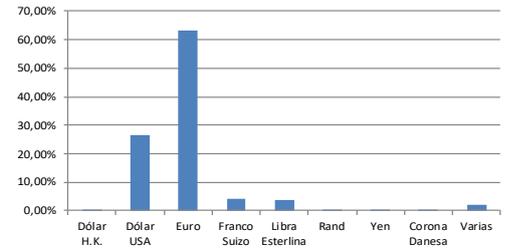
Todos los datos han sido recogidos el último día hábil de mes al que hace referencia la ficha.

Visión general de la cartera

Efectivo sobre patrimonio

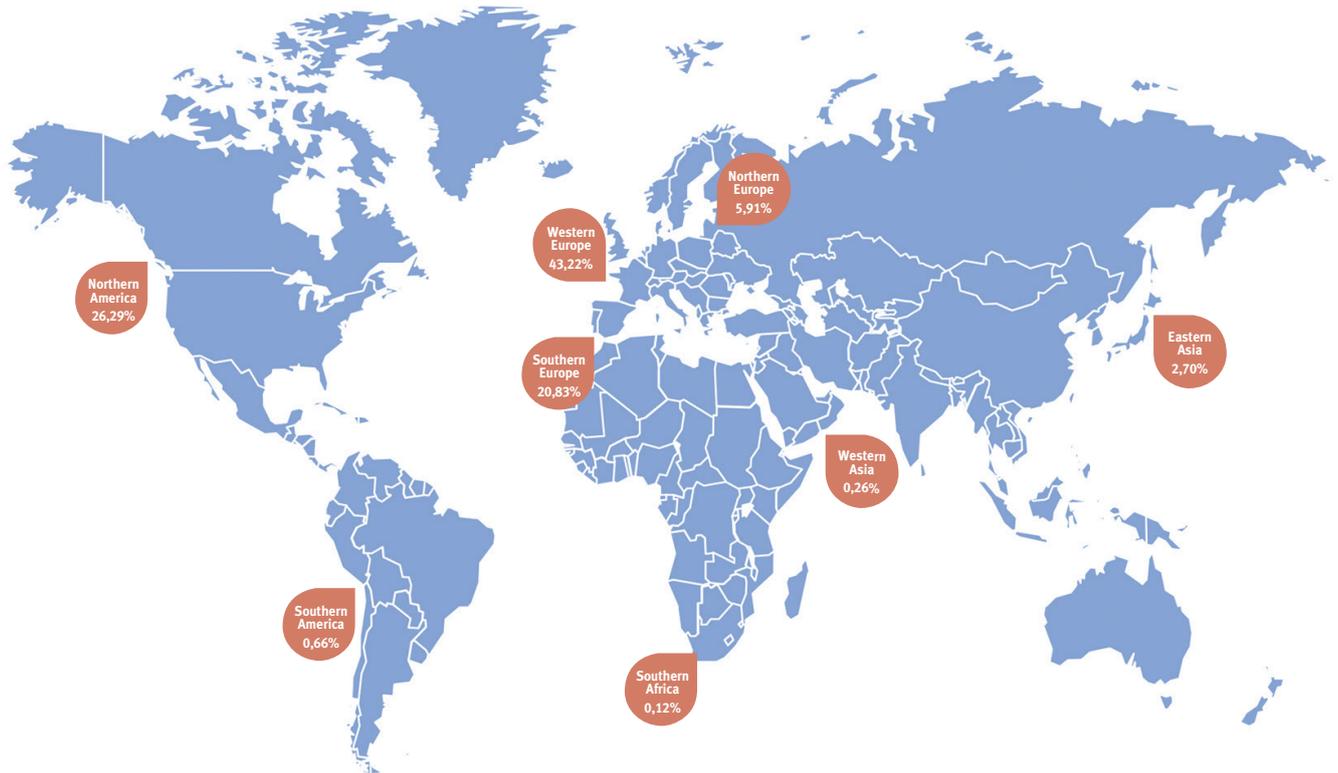


Riesgo divisa sobre patrimonio

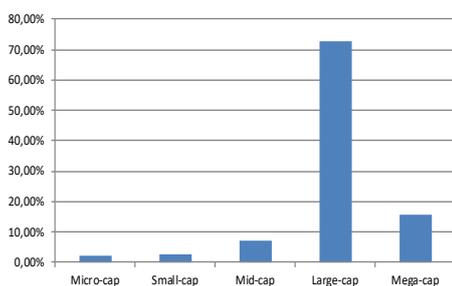


Cartera de acciones

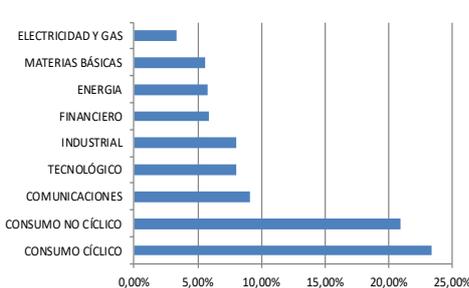
Distribución de la cartera de acciones por sub-región sobre patrimonio



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

WOLTERS KLUWER	4,38%
LVMH MOET HENNESSY	
LOUIS VUITTON SA	3,96%
MICROSOFT CORP	3,94%
BMW - BAYERISCHE MOTOREN WERKE PREF	3,82%
INDITEX SA	3,28%

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.