

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 2,48 €

Patrimonio neto 33.396.021,55 €

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

Depositario 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) 1,39%

Información comercial

Código ISIN ES0176388033

Código Bloomberg S3502 SM EQUITY

Mercado de cotización Mercado Alternativo Bursátil (MAB)

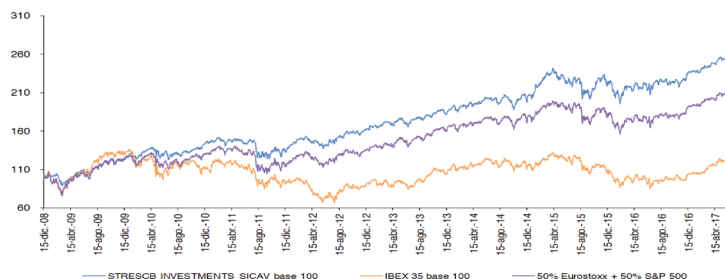
Estrategia de inversión

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	-2,34%	4,61%	4,61%	13,81%	22,83%	69,61%		147,10%
IBEX 35	-4,00%	11,68%	11,68%	27,94%	-4,39%	47,06%		16,37%
50% Eurostoxx + 50% S&P 500	-1,35%	6,46%	6,46%	17,95%	16,04%	66,96%		104,29%

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	8,25%	13,02%	11,60%		13,33%
	IBEX 35	14,52%	21,65%	21,34%		24,01%
	50% Eurostoxx + 50%	9,14%	14,94%	14,01%		17,77%
Ratio Sharpe anualizado*	STRESCB INVESTMENTS	1,75	0,54	0,95		0,75
	IBEX 35	1,97	NA	0,37		0,03
	50% Eurostoxx + 50%	2,03	0,34	0,76		0,43
Alpha de Jensen anualizada*	IBEX 35	1,63%	7,84%	7,43%		9,88%
	50% Eurostoxx + 50%	-0,80%	2,92%	2,83%		7,77%
Beta	IBEX 35	0,45	0,52	0,45		0,23
	50% Eurostoxx + 50%	0,82	0,82	0,77		0,30
Coef. Correlación	IBEX 35	78,92%	85,69%	83,69%		41,99%
	50% Eurostoxx + 50%	90,89%	94,13%	92,69%		39,88%
	IBEX 35	9,47%	12,46%	13,25%		22,03%
Tracking Error anualizado	50% Eurostoxx + 50%	5,82%	5,76%	5,79%		17,52%
	IBEX 35	-1,28	0,54	0,09		0,30
Ratio Información anualizado	50% Eurostoxx + 50%	-1,57	-0,05	-0,19		0,05
	IBEX 35	-0,64%	0,02%	0,12%		1,11%
Rentabilidad anualizada activo libre de riesgo*	2016	2015				
Rotación de la cartera	0,16	0				

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

*Anualización = 252 días

Resumen de exposición de riesgos sobre patrimonio

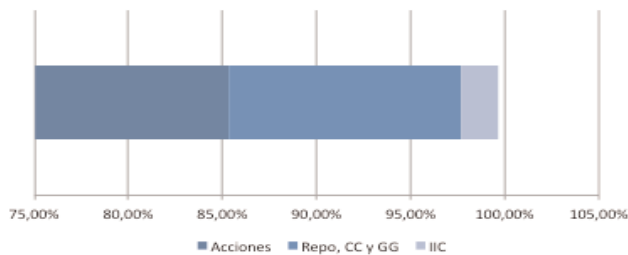
	Inversión Directa	Inversión IICs	Inversión Derivados	Exposición Neta
Renta Variable	85,30%	2,00%		87,29%

Rentabilidades mensuales

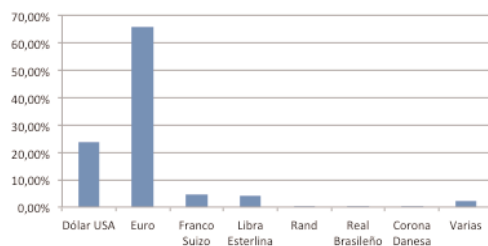
		12	11	10	9	8	7	6	5	4	3	2	1	Anuales
2017	STRESCB INVESTMENTS SICAV							-2,34%	0,41%	1,40%	2,75%	2,77%	-0,36%	4,61%
	IBEX 35							-4,00%	1,53%	2,42%	9,50%	2,58%	-0,39%	11,68%
	50% Eurostoxx + 50% S&P 500							-1,35%	0,51%	1,31%	2,68%	3,24%	-0,02%	6,46%
2016	STRESCB INVESTMENTS SICAV	3,62%	1,93%	0,07%	-0,40%	-0,11%	3,46%	-2,34%	1,89%	0,59%	2,15%	-0,21%	-5,05%	5,38%
	IBEX 35	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%
	50% Eurostoxx + 50% S&P 500	4,7%	1,64%	-0,09%	-0,38%	0,50%	4,00%	-3,19%	1,37%	0,56%	4,30%	-1,78%	-5,89%	5,40%
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	-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%
	50% Eurostoxx + 50% S&P 500	-4,26%	1,34%	9,28%	-3,86%	-7,64%	3,60%	-3,07%	-0,08%	-0,66%	0,50%	6,45%	1,64%	2,03%
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	-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%
	50% Eurostoxx + 50% S&P 500	-1,77%	3,46%	-0,57%	0,07%	2,81%	-2,49%	0,70%	1,78%	0,91%	0,57%	4,41%	-3,30%	6,44%
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	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%
	50% Eurostoxx + 50% S&P 500	1,55%	1,71%	5,26%	4,65%	-2,40%	5,69%	-3,77%	2,12%	2,61%	1,61%	-0,70%	3,79%	23,93%
2012	STRESCB INVESTMENTS SICAV	1,69%	1,04%	1,49%	2,74%	1,44%	2,74%	3,13%	-4,24%	-0,79%	-0,55%	3,86%	3,99%	17,52%
	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%
	50% Eurostoxx + 50% S&P 500	1,54%	1,58%	0,02%	0,04%	5,02%	2,00%	5,43%	-7,17%	-3,84%	0,86%	4,02%	4,38%	13,94%
2011	STRESCB INVESTMENTS SICAV	5,80%	-5,97%	7,67%	-0,42%	-10,76%	-0,22%	-1,57%	-1,03%	0,92%	-0,21%	1,41%	1,56%	-4,03%
	IBEX 35	1,38%	-5,64%	4,78%	-1,97%	-9,47%	-7,04%	-1,11%	-3,70%	2,86%	-2,53%	0,41%	9,60%	-13,11%
	50% Eurostoxx + 50% S&P 500	0,15%	-1,36%	10,19%	-6,14%	-9,73%	-4,21%	-1,13%	-3,15%	3,16%	-1,75%	2,61%	4,02%	-8,48%

Visión general de la cartera

Efectivo sobre patrimonio

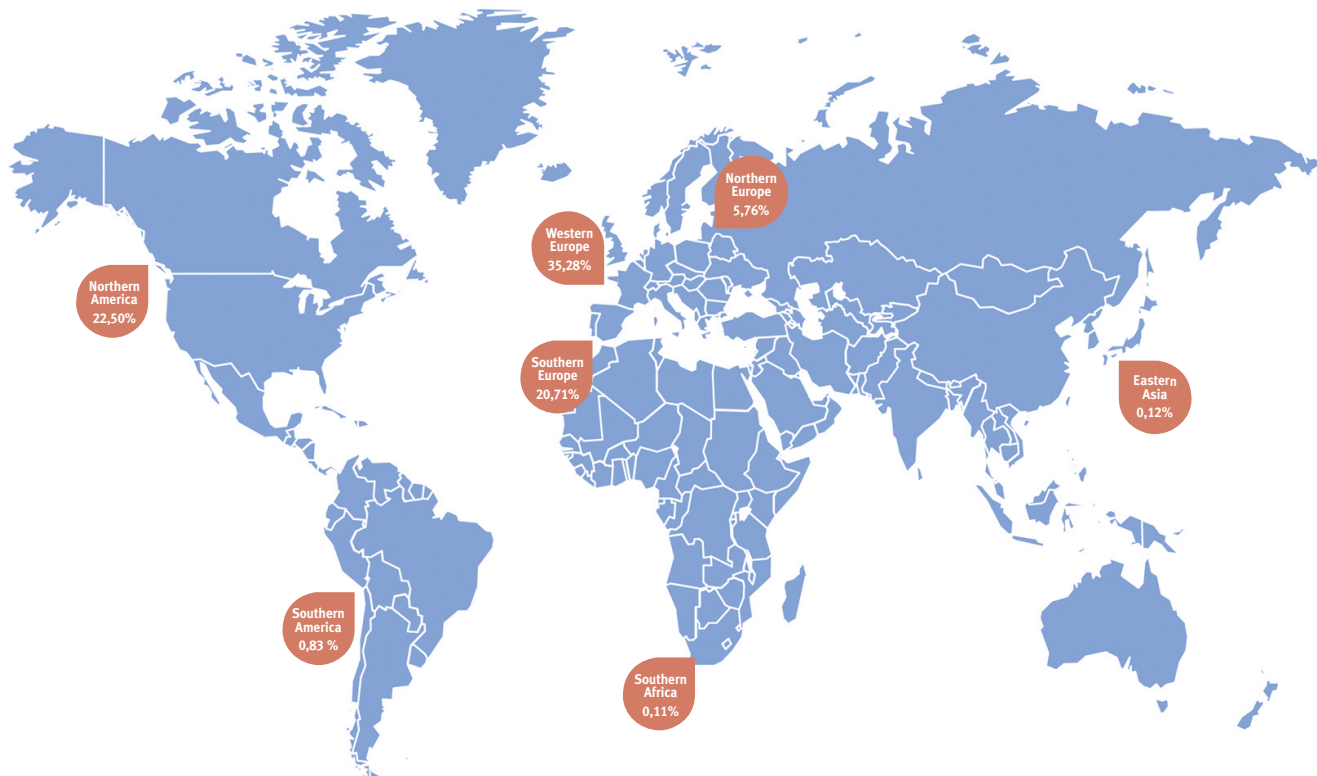


Riesgo divisa sobre patrimonio

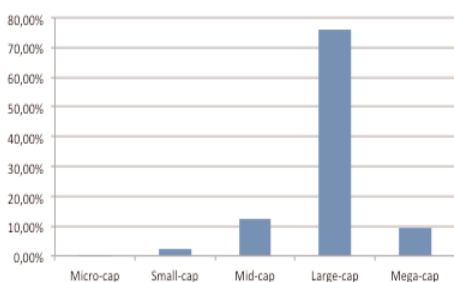


Cartera de acciones

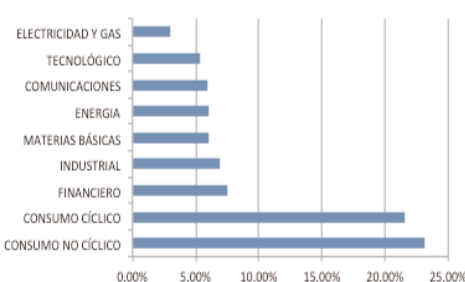
Distribución de la cartera de acciones por sub-región sobre patrimonio



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

BMW - BAYERISCHE MOTOREN WERKE PREF	4,30%
WOLTERS KLUWER	3,44%
HEINEKEN NV	3,21%
INDITEX SA	3,20%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	3,10%

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.