

Información del fondo

Denominación social

Deep Value International, FI

Política de inversión

Categoría
(Circular 3/2011 de CNMV) Renta variable Internacional

Índice de referencia
90% MSCI EUROPE NTR +
10% S&P 500 NTR

Datos claves

Valor liquidativo 9,48 €

Patrimonio neto 4.048.956,90 €

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 4828

Sociedad Gestora Gesiuris Asset Management, SGIIC, SA.

Gestor Salvador Alegre Segura

Asesor

Depositario Santander Securities Services, S.A.

Auditor Deloitte, S.L.

Fecha de constitución 17/10/14

Fecha de registro 14/11/14

Fecha inicio política de inversión actual 14/11/14

Inversión mínima

Comisión de gestión s/patrimonio 1,75%

Comisión de gestión s/resultados No tiene

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) 1,96%

Información comercial

Código ISIN ES0126082009

Código Bloomberg GDEEPPV SM EQUITY

Mercado de cotización -

Estrategia de inversión

El fondo tiene una exposición mínima del 75% en renta variable, sin que existan límites predeterminados en lo que se refiere a la distribución de activos por capitalización bursátil. Invertirá principalmente en valores de países de la Zona Euro, EE.UU, UK, Suiza y demás países de la OCDE. Además podrá invertir en países emergentes hasta un 20%. El resto de exposición será a renta fija, preferentemente de emisores públicos, de países de la OCDE, con duración media inferior a 18 meses. La calificación crediticia será media-alta, (BBB- o superior) según, S&P. Dentro de la renta fija se incluyen depósitos en entidades de crédito, e instrumentos del mercado monetario no cotizados que sean líquidos, con la misma calidad crediticia que el resto de la renta fija.

La metodología de selección de valores del fondo se centra exclusivamente en el concepto "profundamente valor" (deep value), que supone realizar un exhaustivo análisis de las compañías seleccionadas exigiendo el cumplimiento de los parámetros de calidad y de análisis fundamental establecidos.

El fondo no invertirá en mercados de reducida dimensión y limitado volumen de contratación.

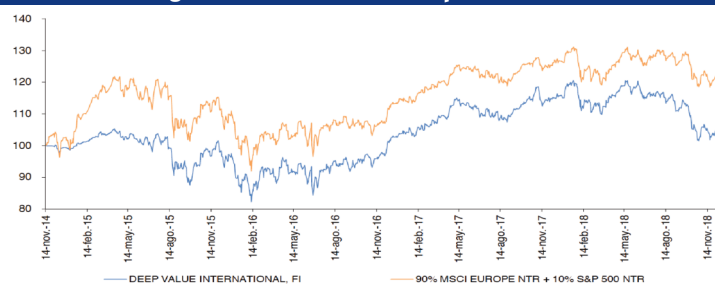
No existe límite en cuanto a la exposición a divisa.

Se podrá invertir hasta un 10% del patrimonio en IIC financieras que sean activo apto, armonizadas y no armonizadas, que sean o no del grupo de la Gestora.

Rentabilidades acumuladas

	1 mes	6 meses	Año actual	1 año	3 años	5 años	10 años	Inicio de la gestión
DEEP VALUE INTERNATIONAL	-8,08%	-17,77%	-17,54%	-17,54%	-1,64%			-5,19%
90% MSCI EUROPE NTR + 10% S&P	-11,55%	-15,25%	-15,36%	-15,36%	-2,48%			6,95%

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	DEEP VALUE INTERNATIONAL	12,72%	14,12%			13,93%
	90% MSCI EUROPE NTR + 10	12,60%	13,76%			15,27%
Ratio Sharpe anualizado*	DEEP VALUE INTERNATIONAL	NA	NA			NA
	90% MSCI EUROPE NTR + 10	NA	NA			0,12
Alpha de Jensen anualizada*	90% MSCI EUROPE NTR + 10	-4,71%	0,25%			-2,59%
	DEEP VALUE INTERNATIONAL	0,83	0,94			0,82
Beta	90% MSCI EUROPE NTR + 10	82,35%	91,64%			89,71%
	DEEP VALUE INTERNATIONAL	7,53%	5,71%			6,75%
Coef. Correlación	90% MSCI EUROPE NTR + 10	-0,33	0,06			-0,45
	DEEP VALUE INTERNATIONAL	-0,37%	-0,35%			-0,19%
Tracking Error anualizado	90% MSCI EUROPE NTR + 10	2016				
	DEEP VALUE INTERNATIONAL	2016				
Ratio Información anualizado	90% MSCI EUROPE NTR + 10	0,21				
	DEEP VALUE INTERNATIONAL	0,49				
Rentabilidad anualizada activo libre de riesgo*	2017					
	2016					
Rotación de la cartera	2017					
	2016					

*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	95,00%			95,00%

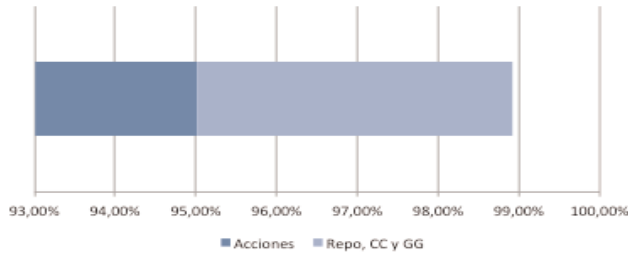
Rentabilidades mensuales

		12	11	10	9	8	7	6	5	4	3	2	1	Anuales
2018	DEEP VALUE INTER	-8,08%	-1,10%	-7,28%	-1,73%	-1,56%	0,84%	-0,79%	-0,70%	4,12%	-1,02%	-4,24%	3,14%	-17,54%
	90% MSCI EUROPE NTR + 10	-11,55%	-0,57%	-5,46%	0,53%	-1,71%	3,17%	-0,56%	0,33%	4,19%	-2,07%	-3,83%	2,01%	-15,36%
2017	DEEP VALUE INTER	0,11%	-2,45%	4,23%	3,72%	-0,05%	0,04%	-3,28%	0,09%	2,76%	4,17%	1,93%	0,32%	11,86%
	90% MSCI EUROPE NTR + 10	0,82%	-1,59%	2,00%	3,70%	-0,67%	-0,13%	-2,18%	1,51%	1,62%	3,01%	3,02%	-0,15%	11,31%
2016	DEEP VALUE INTER	5,32%	1,65%	1,57%	0,54%	0,53%	5,29%	-5,36%	0,26%	2,30%	2,43%	-1,91%	-5,53%	6,64%
	90% MSCI EUROPE NTR + 10	5,45%	1,34%	-0,92%	-0,02%	0,64%	3,53%	-3,80%	2,23%	1,77%	1,87%	-1,98%	-6,09%	3,51%
2015	DEEP VALUE INTER	-5,09%	3,49%	9,97%	-5,72%	-6,28%	0,86%	-2,14%	-0,35%	-0,99%	1,06%	2,07%	1,33%	-2,84%
	90% MSCI EUROPE NTR + 10	-4,90%	2,43%	8,30%	-4,11%	-8,15%	3,81%	-4,36%	1,40%	0,11%	1,34%	6,80%	6,17%	7,60%
2014	DEEP VALUE INTERNATIONAL, FI	-0,68%												
	90% MSCI EUROPE NTR + 10	-1,29%												
2013	DEEP VALUE INTERNATIONAL, FI													
	90% MSCI EUROPE NTR + 10													
2012	DEEP VALUE INTERNATIONAL, FI													
	90% MSCI EUROPE NTR + 10													

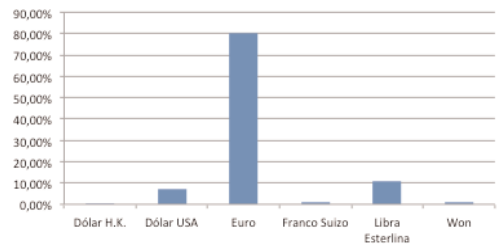
Todos los datos han sido recogidos el último día hábil de mes al que hace referencia la ficha.

Visión general de la cartera

Efectivo sobre patrimonio

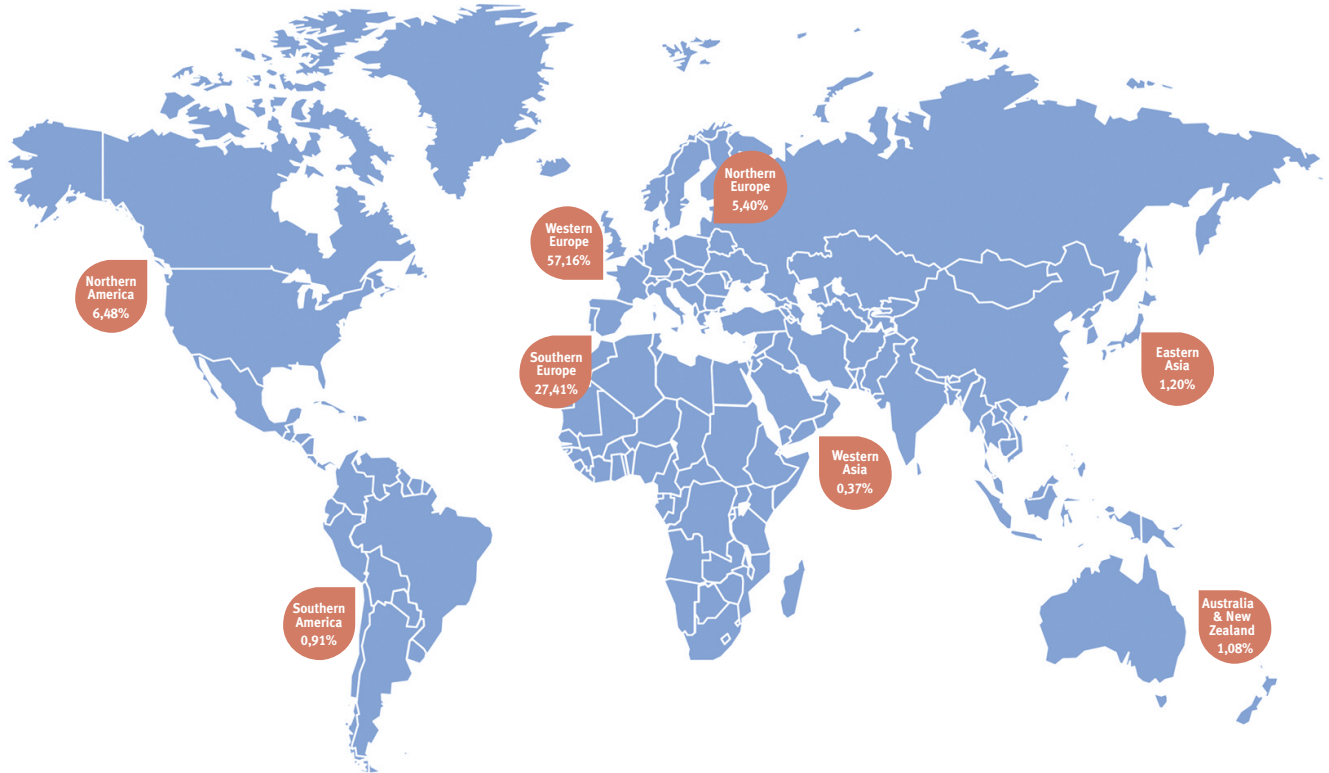


Riesgo divisa sobre patrimonio

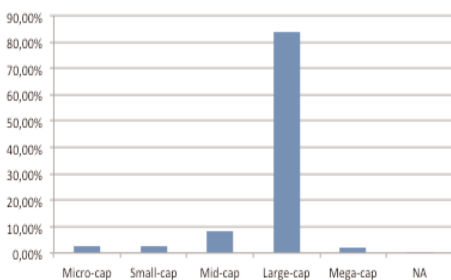


Cartera de acciones

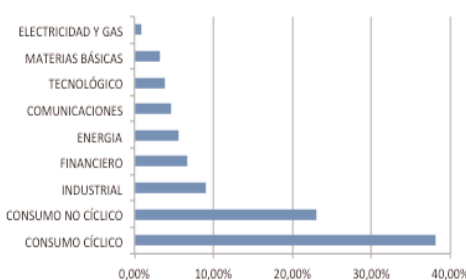
Distribución de la cartera de acciones por sub-región sobre patrimonio



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

LVMH MOET HENNESSY	
LOUIS VUITTON SA	9,88%
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	7,13%
BMW - BAYERISCHE MOTOREN WERKE PRF	6,45%
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - PRF	5,74%
GRIFOLS SA - CLASE B	5,58%

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.