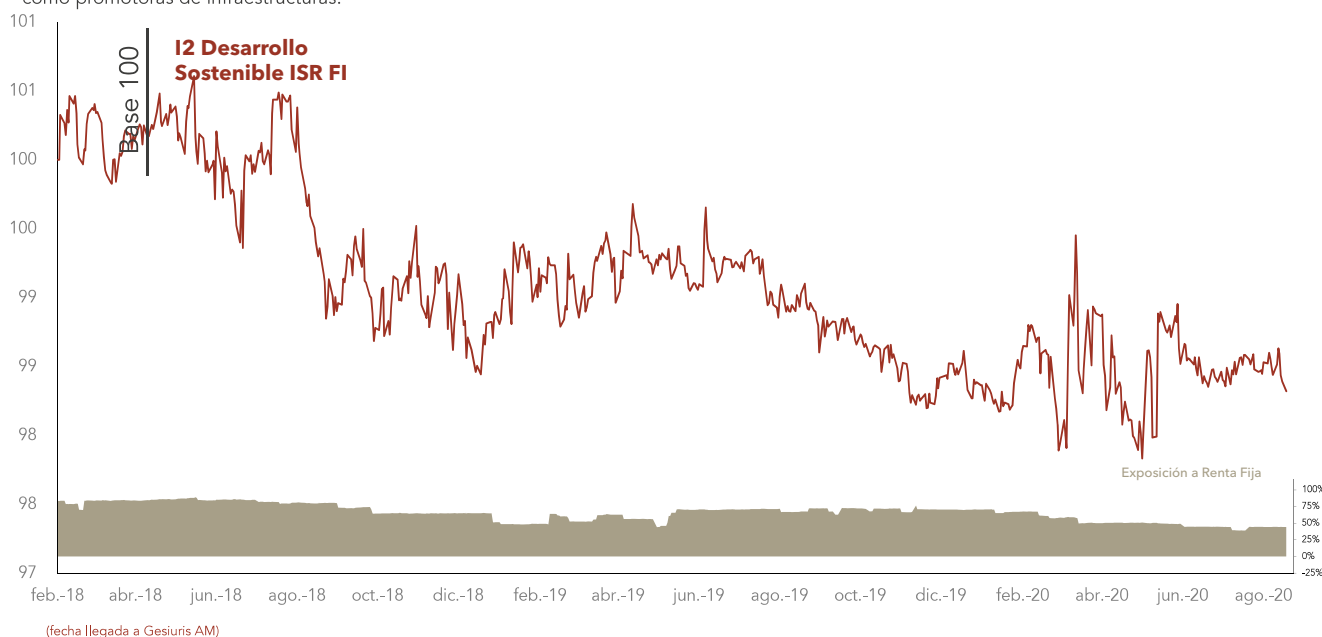


POLÍTICA DE INVERSIÓN

Fondo de inversión que aplica criterios ISR (Inversión Socialmente Responsable) en su estrategia de Inversión de Impacto. Además de la rentabilidad financiera, se exige a los activos en que invierte una rentabilidad social intencionada y medible en el marco de los 17 Objetivos de Desarrollo Sostenible firmados por todos los países miembros de la Organización de Naciones Unidas en 1975. La selección de emisores de Renta Fija la realizará el Comité de Inversiones, integrando el desempeño de cada compañía en aspectos ambientales, sociales y de buen gobierno en el análisis financiero. La exposición máxima a renta variable será del 30%, sin límites de capitalización, divisas, sectores o países, aunque sí deberán estar reconocidas por el Banco Mundial como promotoras de infraestructuras.



RENTABILIDADES ANUALES

2020	2019	2018
-0,30%	0,17%	-1,55%

RETORNOS DESDE FEBRERO 2018 HASTA AGOSTO 2020

	I2 Desarrollo Sostenible ISR FI	Índice de Referencia *
Rentabilidad Simple	-1,68%	3,61%
1000 €	983,22 €	1.036,12 €
TAE	-0,66%	1,40%

Exposición Media en Bolsa
1,71%

Años de Rentabilidad Positiva
1 de 3 años

* 30% Eurostoxx-50 Net Return + 40% Bloomberg Barclays Spain Govt 1-3 Y + 30% Bloomberg Barclays Spain Govt 3-5 YR

RENTABILIDADES ACUMULADAS

	Acumulado 2020	en 1 mes	en 6 meses	en 1 año	en 3 años	en 5 años	en 10 años	desde creación	Valor Liquidativo 31/08/2020
Rentabilidad	-0,30%	-0,27%	-0,28%	-0,71%				-1,68%	9,25 €
TAE	-	-	-	-0,71%				-0,66%	

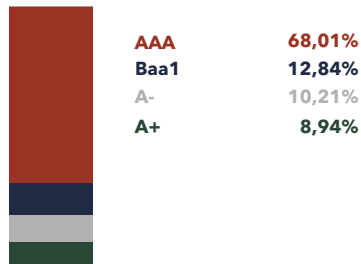
I2 Desarrollo Sostenible ISR FI

EXPOSICIÓN DE RIESGOS SOBRE PATRIMONIO

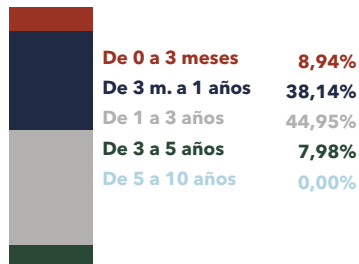
	Exposición Neta	Inversión Directa	Inversión IIC	Inversión Derivados
Renta Variable	1,32%	1,32%	0,00%	0,00%
Renta Fija	44,08%	44,08%	0,00%	0,00%
Inversión Alternativa	9,36%	0,00%	9,36%	0,00%

ANÁLISIS RENTA FIJA

Distribución por Ráting



Distribución por Duración



MAYORES POSICIONES

FRN. EUROPEAN INVEST BANK 15/01/21
 BN. BANQUE OUEST AFRICAINE 5,5% 21
 FRN. EUROPEAN INVEST BANK 22/01/23
 FRN KFW FLOAT 21/11/22
 BN. EUROPEAN INVEST BANK 2,625% 20/05/22
 BN. BLACK SEA TRADE&DEV 4,875% 06/05/21
 FRN ASIAN DEVELOPMENT BANK 15/12/21
 BN. CORP ANDINA DE FOMENTO 1% 10/11/20
 BN. ASIAN INFRASTRUC. INV 2,25% 16/05/24

Riesgo de Divisa sobre Patrimonio

Euro **52,80%** **Dólar USA** **37,81%** **Varias** **9,35%** **Dólar H.K.** **0,01%** **Corona Danesa** **0,01%**

INDICADORES DE RIESGO

Indicadores de Riesgo		1 Año	3 Años	5 Años	10 Años	Inicio de la Gestión
Volatilidad Anualizada	I2 Desarrollo Sostenible ISR FI	2,40%				2,27%
	Índice de referencia	9,30%				6,66%
Ratio Sharpe Anualizado*	I2 Desarrollo Sostenible ISR FI	0,21				-0,06
Alpha de Jensen Anualizada*	Índice de referencia	0,44%				-0,33%
Beta	Índice de referencia	0,06				0,10
Coef. Correlación	Índice de referencia	24,83%				29,55%
Rentabilidad Anualizada Activo Libre de Riesgo**		-1,22%				-0,52%

** Activo Libre de Riesgo: Euro Cash Indices LIBOR Total Return 6 Month

* Anualización = 252 días

Denominación Social: I2 Desarrollo Sostenible ISR, FI
 Patrimonio Neto: 3.843.217,78 €
 Cálculo Valor Liquidativo: Diario
 Divisa de Denominación: EUR
 Dividendos: Acumulación
 Forma Legal: Fondo de inversión de derecho español (UCITS IV)

Gestor: Team managed
 Depositario: BANKINTER, S.A.
 Auditor: KPMG AUDITORES, S.L.
 Fecha de Registro: 9/9/2016
 Comisión de Gestión S/Patrimonio: 0,50%
 Comisión de Gestión S/Resultados: 0%
 Comisión Depositaria: 0,100%

Órgano Supervisor: CNMV
 N° Registro: 5063
 Sociedad Gestora: Gesiuris Asset Management SGIIC SA.
 TER (año anterior): 0,77%
 Código ISIN: ES0162864005
 Código Bloomberg: 0

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.