

# SANTANDER COVERED BOND B

Septiembre 2023

## Información general



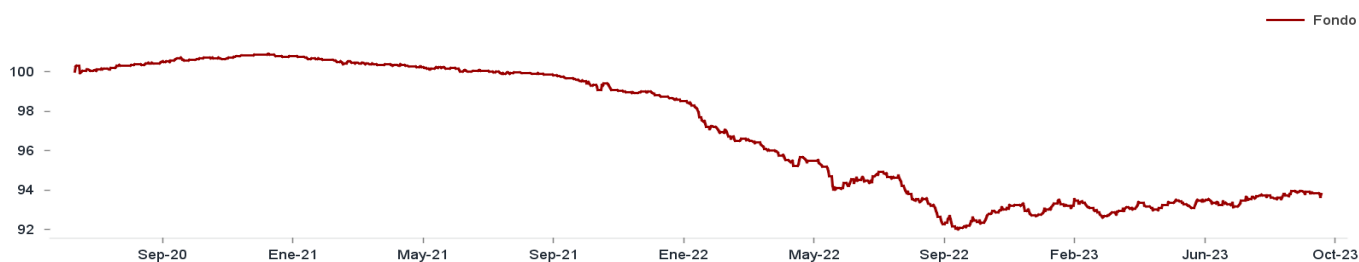
Gestor	Pedro Monteiro Ribeiro
ISIN	LU2063667021
Fecha de lanzamiento	10/06/2020
Divisa de Clase	EUR
Aportación Mínima	5.000,00 €
Comisión de Gestión	0,35%
Valor Liquidativo	€ 93.81
Patrimonio de Fondo	€15.24M
Número de posiciones	81
Duración Media	3,89
YTM Media	3,95%
Índice	-
Categoría	
Entidad gestora	Santander AM Lux

## Estadísticas\*

	Fondo	Índice
Volatilidad (%)	1,22	-
Ratio de Sharpe	-1,77	-
Ratio de Información	-	-
Beta	-	-
R <sup>2</sup>	-	-
Alfa (%)	-	-
Alfa de Jensen (%)	-	-
Correlación	-	-
Ratio de Treynor	-	-
Tracking Error (%)	-	-

\* Período de cálculo 3 años. Cálculos con valoraciones diarias.

## Rendimiento acumulado desde lanzamiento



## Rentabilidad mensual (%)<sup>1</sup>

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Total
2023	0,48	-0,54	0,40	0,18	0,23	-0,17	0,48	0,23	-0,16	-	-	-	1,14
2022	-0,55	-1,31	-0,51	-0,95	-0,13	-1,12	0,63	-1,50	-1,23	0,07	0,72	-0,35	-6,08
2021	-0,12	-0,24	-0,06	-0,08	-0,07	-0,15	-0,13	-0,01	-0,21	-0,61	-0,13	-0,19	-2,00
2020	-	-	-	-	-	-	0,20	0,12	0,17	0,07	0,18	-0,07	0,76
2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

<sup>1</sup> Cálculos netos de comisiones.

## Política de inversión

El Subfondo invertirá en covered bonds regulados de acuerdo con la Directiva 2009/65/CE denominados en euros, así como en emisiones de emisores corporativos, supranacionales, gubernamentales y cuasi gubernamentales. El Subfondo no invertirá en valores no valorados ni distressed. La duración de la cartera será de entre 0 y 2,5 años.

## Rentabilidad acumulada (%)<sup>1</sup>

	1M	3M	6M	YTD	1Y	Lanzam.*
<b>Fondo</b>	-0,16	0,55	0,80	1,14	1,59	-1,84
<b>Índice</b>						

Rentabilidad anualizada\*

## Rentabilidad anual (%)<sup>1</sup>

	2023	2022	2021	2020*	2019	2018
<b>Fondo</b>	1,14	-6,08	-2,00	0,76	-	-
<b>Índice</b>						

\* Desde inicio.

## Volatilidad anual (%)<sup>1</sup>

	2023	2022	2021	2020*	2019	2018
<b>Fondo</b>	1,33	1,66	0,56	0,73	-	-
<b>Índice</b>						

\* Desde inicio.

## Distribución de cartera

### 10 principales posiciones (%)

	17,39
Nord/lb Luxembourg S.a. Covered Bond Bank 0.05% 28-jan-2025	2,49
Credito Emiliano Spa 1.125% 17-jan-2024	1,97
Caja Rural De Navarra 0.875% 08-may-2025	1,88
Bankia, S.a. 1.0% 25-sep-2025	1,86
Banco De Sabadell, S.a. 1.75% 30-may-2029	1,77
Mediobanca Banca Di Credito Finanziario S.p.a Frn 25-jan-2024	1,66
Nationale-nederlanden Bank Nv 0.01% 08-jul-2030	1,55
Banco Santander, S.a. 0.125% 04-jun-2030	1,55
Landsbankinn Hf. 4.25% 16-mar-2028	1,34
Raiffeisen Bank International Ag 3.875% 16-mar-2026	1,33

### Divisa (%)

EUR	100,00
USD	-0,00

### Emisor de deuda (%)

	Fondo	Índice	Dif
Caja Rural de Navarra	4,30	-	-
Banco Santander, S.A.	3,98	-	-
Credit Agricole Home Loan SFH SA	3,74	-	-
Mediobanca Banca di Credito Finanziario S.p.A	3,40	-	-
Credit Agricole Italia S.p.A	3,30	-	-
Credito Emiliano SpA	3,15	-	-
NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank	2,49	-	-
Bankinter SA	2,47	-	-
Compagnie de Financement Foncier SA	2,44	-	-
Otros	21,96	-	-

### Distribución Geográfica (%)

	Fondo	Índice	Dif
Ajuste Efectivo	33,92	-	-
Italia	14,65	-	-
España	13,98	-	-
Francia	11,14	-	-
Países Bajos	7,76	-	-
Estados Unidos	2,57	-	-
Austria	2,55	-	-
Reino Unido	2,51	-	-
Efectivo	14,86	-	-
Otros	-3,95	-	-

El propósito de este documento es proporcionar información que resuma las características principales del producto y bajo ninguna circunstancia constituye un acuerdo contractual, una recomendación, asesoramiento personalizado, una oferta o una captación. Esta comunicación es material de promoción comercial.

Se recomienda consultar el Folleto y el KIID (Documento de datos fundamentales para el inversor) antes de tomar una decisión de inversión, suscribir o comprar acciones o reembolsar inversiones, junto con la lista de países en los que el producto está registrado para la venta, disponible en [www.santanderassetmanagement.lu](http://www.santanderassetmanagement.lu) o a través de intermediarios autorizados en su país de residencia. No se ha comprobado que los datos contenidos en este documento cumplan los requisitos de comercialización de todos los países de venta. El producto descrito en este documento puede no ser apto para su venta o distribución en ciertas jurisdicciones o para ciertas categorías o tipos de inversores. Este producto no puede ofrecerse ni venderse directa o indirectamente a, o en beneficio de, un ciudadano de los Estados Unidos de acuerdo con la normativa de la FATCA (Ley de cumplimiento tributario de cuentas extranjeras), en línea con las restricciones de venta establecidas en el folleto del fondo.

Este fondo tiene un folleto redactado en inglés que se puede obtener en [www.santanderassetmanagement.lu](http://www.santanderassetmanagement.lu)

Para obtener información sobre el producto, póngase en contacto con Santander Asset Management Luxembourg S.A. (43, Avenue John F.Kennedy L-1855 Luxemburgo - Gran Ducado de Luxemburgo), sociedad gestora del fondo bajo la supervisión de la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). El depositario y administrador del fondo es JP Morgan SE, Luxembourg Branch (6, route de Treves, L-2633 Senningerberg - Gran Ducado de Luxemburgo).

La inversión en fondos de inversión puede estar sujeta a riesgos de inversión, incluidos, entre otros, riesgo de mercado, riesgo de crédito, riesgo de emisor y contraparte, riesgo de liquidez, riesgo de divisas y, cuando proceda, riesgos relativos a mercados emergentes. Además, si los fondos mantienen inversiones en fondos de inversión libre, activos, fondos inmobiliarios, materias primas y capital riesgo, debe tenerse en cuenta que estos pueden estar sujetos a riesgos operativos y de valoración inherentes a este tipo de activos y mercados, así como al riesgo de fraude o riesgo derivado de la inversión en mercados no regulados o no supervisados o activos no cotizados.

La rentabilidad histórica no es indicativa de los resultados futuros. Las rentabilidades se calculan sobre la base del valor liquidativo, netas de comisiones, y se anualizan para períodos superiores a un año.

Antes de invertir en el fondo, es aconsejable que el inversor busque asesoramiento personalizado sobre tributación, ya que depende de las circunstancias individuales de cada inversor y puede cambiar en el futuro.

Los inversores pueden obtener un resumen de los derechos de los inversores en [www.santanderassetmanagement.lu](http://www.santanderassetmanagement.lu)

La información contenida en este documento se considera fiable, pero Santander Asset Management Luxembourg S.A. no garantiza su integridad ni exactitud.

