

# SANTANDER GO SHORT DURATION DOLLAR B

Septiembre 2023

## Información general

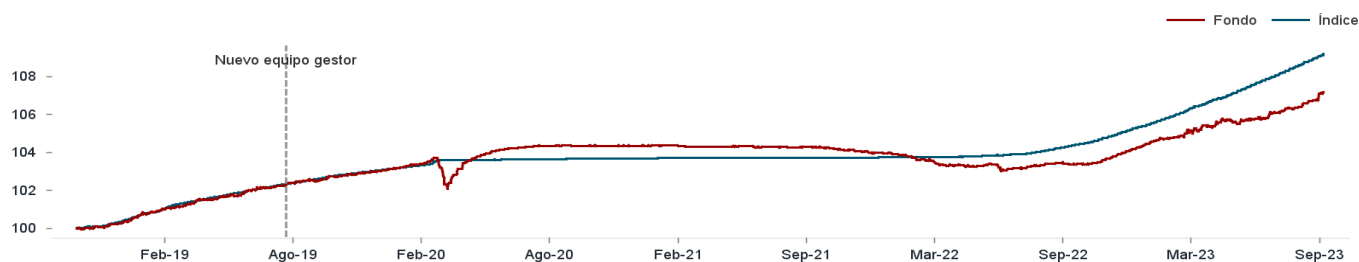
|                      |                                    |
|----------------------|------------------------------------|
| Gestor               | JP Morgan Asset Management         |
| ISIN                 | LU0082919001                       |
| Fecha de lanzamiento | 31/12/1997                         |
| Divisa de Clase      | USD                                |
| Aportación Mínima    | 25.000,00 \$                       |
| Comisión de Gestión  | 0,40%                              |
| Valor Liquidativo    | \$ 171.35                          |
| Patrimonio de Fondo  | \$589.66M                          |
| Número de posiciones | 152                                |
| Duración Media       | 0,84                               |
| YTM Media            | 5,63%                              |
| Índice               | BofA ML 3M Treasury Bill           |
| Categoría            | R.F. Diversificada Corto Plazo USD |
| Entidad gestora      | Santander AM Lux                   |

## Estadísticas\*

|                      | Fondo | Índice |
|----------------------|-------|--------|
| Volatilidad (%)      | 0,49  | 0,18   |
| Ratio de Sharpe      | -1,93 | -0,50  |
| Ratio de Información | -1,76 |        |
| Beta                 | 0,59  |        |
| R <sup>2</sup>       | 0,05  |        |
| Alfa (%)             | -0,13 |        |
| Alfa de Jensen (%)   | -0,89 |        |
| Correlación          | 0,22  |        |
| Ratio de Treynor     | -0,02 |        |
| Tracking Error (%)   | 0,48  |        |

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

## Rendimiento acumulado a 5 años



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

|      | Ene   | Feb   | Mar   | Abr   | May  | Jun   | Jul  | Ago   | Sep   | Oct   | Nov   | Dic   | Total |
|------|-------|-------|-------|-------|------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2023 | 0,43  | 0,13  | 0,35  | 0,35  | 0,11 | 0,09  | 0,41 | 0,36  | 0,57  | -     | -     | -     | 2,82  |
| 2022 | -0,19 | -0,16 | -0,26 | -0,10 | 0,13 | -0,22 | 0,15 | 0,10  | -0,04 | 0,09  | 0,36  | 0,40  | 0,26  |
| 2021 | 0,00  | -0,02 | -0,04 | 0,01  | 0,03 | -0,04 | 0,01 | -0,01 | -0,05 | -0,12 | -0,07 | -0,06 | -0,37 |
| 2020 | 0,23  | 0,22  | -0,87 | 0,96  | 0,38 | 0,18  | 0,11 | 0,03  | -0,03 | -0,00 | 0,02  | -0,01 | 1,20  |
| 2019 | 0,30  | 0,13  | 0,35  | 0,17  | 0,22 | 0,24  | 0,10 | 0,26  | 0,11  | 0,22  | 0,09  | 0,17  | 2,37  |
| 2018 | -0,10 | -0,07 | 0,07  | -0,01 | 0,24 | 0,03  | 0,11 | 0,22  | -0,01 | 0,05  | 0,20  | 0,48  | 1,21  |

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

## Política de inversión

Santander GO Short Duration Dollar pretende lograr un rendimiento superior al de los mercados monetarios de los Estados Unidos invirtiendo principalmente en títulos de deuda a corto plazo denominados en USD. Política de inversión: El Subfondo puede invertir en bonos del Estado, títulos de deuda corporativa y efectivo. La duración promedio ponderada de la cartera no superará el año, y el vencimiento inicial o restante de cada título de deuda no superará los tres años a partir de la fecha de liquidación.

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

|        | 1M   | 3M   | 6M   | YTD  | 1Y   | Lanzam.* |
|--------|------|------|------|------|------|----------|
| Fondo  | 0,57 | 1,34 | 1,89 | 2,82 | 3,69 | 1,85     |
| Índice | 0,46 | 1,32 | 2,56 | 3,68 | 4,60 | 2,09     |

Rentabilidad anualizada\*

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

|        | 2023 | 2022 | 2021  | 2020 | 2019 | 2018 |
|--------|------|------|-------|------|------|------|
| Fondo  | 2,82 | 0,26 | -0,37 | 1,20 | 2,37 | 1,21 |
| Índice | 3,68 | 1,53 | 0,05  | 0,54 | 2,41 | 1,95 |

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

|        | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 |
|--------|------|------|------|------|------|------|
| Fondo  | 0,82 | 0,40 | 0,15 | 0,77 | 0,41 | 0,46 |
| Índice | 0,22 | 0,14 | 0,01 | 0,08 | 0,13 | 0,22 |

## Distribución de cartera

### 10 principales posiciones (%)

24,88

|                                                               |       |
|---------------------------------------------------------------|-------|
| Government Of The United States Of America 4.625% 15-mar-2026 | 10,26 |
| Federal Home Loan Bank System 4.875% 14-jun-2024              | 2,59  |
| Federal Home Loan Bank System 4.75% 08-mar-2024               | 1,91  |
| Government Of The United States Of America 3.625% 15-may-2026 | 1,90  |
| Standard Chartered Bank 5.44% 12-jan-2024                     | 1,75  |
| Florida Power & Light Company Frn 12-jan-2024                 | 1,40  |
| Government Of The United States Of America 0.375% 15-jul-2024 | 1,40  |
| Government Of The United States Of America 0.375% 31-jan-2026 | 1,29  |
| Government Of The United States Of America 1.5% 15-feb-2025   | 1,23  |
| BANCO SANTANDER CHILE CORPORATE COMMERCIAL PAPER              | 1,15  |

### Divisa (%)

|     |        |
|-----|--------|
| USD | 100,00 |
| EUR | -0,00  |

### Emisor de deuda (%)

Fondo Índice Dif

|                                            |       |   |       |
|--------------------------------------------|-------|---|-------|
| Government of the United States of America | 18,64 | - | 18,64 |
| Federal Home Loan Bank System              | 6,49  | - | 6,49  |
| Standard Chartered Bank                    | 1,75  | - | 1,75  |
| MassMutual Global Funding II               | 1,56  | - | 1,56  |
| Toyota Motor Credit Corporation            | 1,54  | - | 1,54  |
| CITIGROUP GBL MKTS INC CORPORATE COMME     | 1,51  | - | 1,51  |
| Principal Life Global Funding II           | 1,50  | - | 1,50  |
| New York Life Global Funding               | 1,48  | - | 1,48  |
| Florida Power & Light Company              | 1,40  | - | 1,40  |
| Otros                                      | 59,06 | - | -     |

### Distribución Geográfica (%)

Fondo Índice Dif

|                |       |        |        |
|----------------|-------|--------|--------|
| Estados Unidos | 59,28 | -      | 59,28  |
| Otros          | 20,83 | -      | 20,83  |
| Reino Unido    | 4,61  | -      | 4,61   |
| Canadá         | 2,52  | -      | 2,52   |
| Francia        | 1,83  | -      | 1,83   |
| Japón          | 1,27  | -      | 1,27   |
| Qatar          | 0,80  | -      | 0,80   |
| Suecia         | 0,75  | -      | 0,75   |
| Efectivo       | 5,06  | 100,00 | -94,94 |
| Otros          | 3,04  | -      | -      |

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 periodos 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.

