

ADVERTENCIA: Esta Ficha forma parte del documento "Información de Producto" compuesto, entre otros, por la siguiente información: Fichas Comercial y de Seguimiento, documento de Datos Fundamentales para el Inversor (DFI) e informe semestral. Para una adecuada comprensión esta Ficha debe entregarse junto con el DFI.

Ficha de Seguimiento

INFORMACIÓN GENERAL

| | |
|---------------------------------|---|
| Gestor | Cristina Rodríguez / Francisco Simon |
| Categoría CNMV | Renta Fija Mixta Euro |
| Código ISIN | ES0145822005 |
| Fecha Registro en CNMV | 30 abr 2009 |
| Inversión Mínima Inicial | 10.000.000 euros |
| Plazo de Inversión (indicativo) | 2 años |
| Entidad Gestora | Santander Asset Management, S.A., SGIIC |
| Entidad Depositaria | CACEIS Bank Spain, S.A.U. |
| Comisión de Gestión | 0,50% |
| Comisión de Gestión Variable | - |
| Comisión sobre Resultados | - |
| Comisión de Depósito | 0,05% |
| Comisión de Suscripción | - |
| Comisión de Reembolso | - |

a) entre 0% y 0,2% Sobre patrimonio medio

DATOS GENERALES

| | |
|-----------------------------|------------|
| Patrimonio Total | €1.989,27M |
| Patrimonio Clase | €0,30M |
| Valor Liquidativo | 103,68 € |
| Número de Activos | 224 |
| Exposición Bursátil | 11,42 |
| Duración Media ⁶ | 1,78 |
| Divisa | EUR |

ESTADÍSTICAS³

| | |
|--------------------|-------|
| Volatilidad (%) | 2,40 |
| Ratio de Sharpe | 0,08 |
| Beta | 0,67 |
| R2 | 0,53 |
| Alfa (%) | -0,81 |
| Correlación | 0,73 |
| Ratio de Treynor | 0,00 |
| Tracking Error (%) | 1,85 |
| Alfa de Jensen (%) | -0,71 |

Perfil de Riesgo¹

| | | | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|---|------------|
| Menos Riesgo | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | Más Riesgo |
|--------------|---|---|---|---|---|---|---|------------|

Política de Inversión

Se invertirá 0%-100% del patrimonio en IIC financieras, incluyendo IIC gestión alternativa (activo apto), armonizadas o no (máximo 30% en IIC no armonizadas) del grupo o no de la Gestora. Se invertirá, directa o indirectamente a través de IIC, hasta 15% en renta variable y el resto en renta fija pública/privada, incluidos depósitos, instrumentos del mercado monetario cotizados o no, líquidos, bonos convertibles, pero no titulaciones. La duración media de la cartera será de 0-5 años. La calidad crediticia de las emisiones será al menos BBB-/Baa3 y un máximo del 10% de la exposición total podrá tener calidad inferior a BBB-/Baa3 o sin rating, o bien el rating que en cada momento tenga el Reino de España, si fuera inferior. Los emisores/mercados serán de países OCDE con un máximo del 10% en emergentes. La suma de exposición en renta fija y en renta variable a países emergentes y/o high yield no superará el 10% de la exposición total. La exposición a riesgo divisa será menor del 15% del total. La suma de renta variable emitida por entidades radicadas fuera de la zona euro más el riesgo divisa no superará el 30% de la exposición total. Se podrá invertir más del 35% del patrimonio en valores emitidos o avalados por un Estado de la UE, o una entidad pública de la que España sea miembro y Estados con solvencia no inferior a la de España. La IIC diversifica las inversiones en los activos mencionados anteriormente en, al menos, seis emisiones diferentes. La inversión en valores de una misma emisión no supera el 30% del activo de la IIC. Se podrá operar con derivados negociados y no negociados en mercados organizados de derivados con la finalidad de cobertura y de inversión.

Rentabilidad Acumulada (%)^{2, 4, 5}

| Fondo | 1 mes | 3 meses | 6 meses | 1 año | 3 años | 5 años |
|-------|-------|---------|---------|-------|--------|--------|
| | -1,09 | -2,13 | -2,59 | -0,41 | - | - |

Rentabilidades superiores a 1 año expresadas en TAE.

Rentabilidad Anual (%)^{4, 5}

| Fondo | 2022 | 2021 | 2020* | 2019 | 2018 | 2017 |
|-------|-------|------|-------|------|------|------|
| | -2,47 | 1,63 | -0,61 | - | - | - |

Rentabilidades correspondientes a años naturales. * Desde inicio.

Volatilidad Anual (%)

| Fondo | 2022 | 2021 | 2020* | 2019 | 2018 | 2017 |
|-------|------|------|-------|------|------|------|
| | 2,91 | 1,81 | 2,82 | - | - | - |

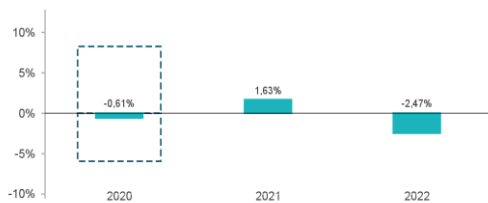
Tipo de Activo (%)

| | |
|--------------------------|-------|
| Renta Variable | 10,64 |
| Derivados Renta Variable | 0,78 |
| Renta Fija | 75,15 |
| Derivados Renta Fija | 0,89 |
| Otros | 19,52 |

Divisa (%)

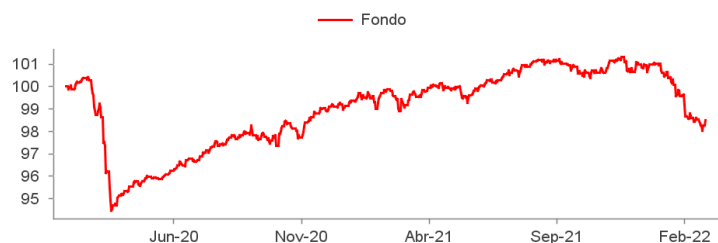
| | |
|-----|-------|
| EUR | 89,81 |
| USD | 9,90 |
| GBP | 0,80 |
| JPY | -0,51 |

Rentabilidad Histórica^{4, 5}



--- En estos años se produjeron modificaciones en la política de inversión. Para más información, consulte el DFI.

Rendimiento acumulado desde lanzamiento



Rentabilidad Mensual (%)^{4, 5}

| | Ene | Feb | Mar | Abr | May | Jun | Jul | Ago | Sep | Oct | Nov | Dic | YTD |
|------|-------|-------|-------|------|-------|------|------|------|-------|-------|------|------|-------|
| 2022 | -1,40 | -1,09 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | -2,47 |
| 2021 | -0,39 | -0,08 | 0,90 | 0,09 | -0,08 | 0,59 | 0,48 | 0,24 | -0,45 | -0,06 | 0,03 | 0,36 | 1,63 |
| 2020 | - | -1,15 | -3,62 | 0,89 | 0,26 | 0,49 | 0,71 | 0,44 | -0,08 | -0,06 | 1,25 | 0,46 | -0,61 |
| 2019 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 2018 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 2017 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

Rentabilidades pasadas no presuponen en ningún caso rentabilidades futuras. Cualquier referencia a resultados pasados no deberá interpretarse como una indicación de resultados futuros.

DISTRIBUCIÓN CARTERA*
5 Principales Posiciones - Renta Fija (%)

| | |
|--|---------------|
| Bnp Paribas Sustainable Enhanced 12m Ia | 4,74% |
| Axa World Eur Cr Shd I Xcape | 3,84% |
| Deposito Banco Santander Sa 0 14/07/2022 | 3,17% |
| Morgan St - Short Mat Euro Bond Z (eur) | 3,17% |
| Ishares Eur Corp Esg 0 3y D | 2,59% |
| Total | 17,51% |

5 Principales Posiciones - Renta Variable (%)

| | |
|---|--------------|
| Invesco S&p 500 Acc | 2,20% |
| Lyxor Etf S&p 500 (eur) Paris | 1,40% |
| Xtrackers S&p 500 Swap Ucits Etf | 1,24% |
| Ishares Core Msci Europe Ucits Etf | 1,06% |
| Db X-trackers Msci Europe Trm Idx T Acc | 1,03% |
| Total | 6,93% |

Distribución Vencimiento Renta Fija Contado (%)

| | |
|---------|--------|
| < 1 año | 10,92% |
| 1 a 3 | 16,12% |
| 3 a 5 | 15,24% |
| 5 a 10 | 15,59% |
| 10 a 30 | 3,52% |

| | |
|-------|--------|
| >30 | 0,10% |
| Otros | 38,51% |

Distribución Geográfica (%) - Renta Fija

| | |
|----------------|--------|
| Luxemburgo | 33,31% |
| Francia | 15,57% |
| Italia | 14,34% |
| España | 12,25% |
| Alemania | 10,16% |
| Irlanda | 6,47% |
| Estados Unidos | 4,47% |
| Países Bajos | 2,17% |
| Reino Unido | 0,42% |
| Resto Países | 0,84% |

Distribución Geográfica (%) - Renta Variable

| | |
|----------------|--------|
| Luxemburgo | 50,58% |
| Irlanda | 40,55% |
| Japón | 7,78% |
| Estados Unidos | 1,09% |

Distribución Sectorial (%) - Renta Variable

| | |
|----------|--------|
| Finanzas | 82,95% |
| Otros | 17,05% |

* Fuente: Santander Asset Management. 10 principales posiciones de la cartera de contado. Distribución de cartera excluyendo las posiciones de efectivo y los derivados de cobertura.

Fuentes y Notas

1. El perfil de riesgo del fondo se corresponde al asignado en el DFI que está publicado por la Comisión Nacional del Mercado de Valores, estando disponible en su página web www.cnmv.es
2. Fuente: Santander Asset Management. Datos a 28/02/2022.
3. Período de cálculo 2 años. Datos calculados con valoraciones diarias.
4. Fuente: Santander Asset Management. Datos a 28/02/2022. Los datos de rentabilidad del fondo están calculados en euros. Los gastos corrientes así como, en su caso, la comisión de resultados están incluidos en el cálculo de la rentabilidad histórica y no incluye el efecto de las posibles comisiones de suscripción y/o reembolso.
5. El 24/01/2020 la clase tuvo una modificación relevante de la vocación/política inversora del Fondo por ello sólo se muestra la evolución del valor liquidativo y rentabilidades a partir de esa fecha, y los datos de rentabilidad histórica solo incluyen datos para periodos completos de los que se disponen de resultados, excepto para el año correspondiente al cambio de política en el que los datos se muestran desde esa fecha.
6. Para el cálculo de la duración media de la cartera de renta fija se tienen en cuenta la duración de todas las posiciones de la cartera de renta fija, tanto de contado como a través de derivados (excepto por las posiciones que pudiera tener en IIC's), tomándose como base para su cálculo la cartera de renta fija de contado del fondo.

Aviso Legal

El presente documento está concebido con carácter informativo y en ningún caso constituye un elemento contractual, ni una recomendación, ni asesoramiento personalizado, ni oferta, ni solicitud. Se recomienda la consulta del DFI (Documento con Datos Fundamentales para el Inversor) antes de tomar cualquier decisión de inversión, suscripción o compra de acciones o participaciones o desinversión y los países en que está registrado el producto para su comercialización en www.santanderassetmanagement.es o a través de los comercializadores autorizados en su país de residencia. No se ha comprobado que los datos contenidos en esta ficha respondan a los requisitos de comercialización de todos los países de venta ya que solo se trata de un documento de información y no de comercialización del producto. Este producto no puede comercializarse a personas estadounidenses o residentes en Estados Unidos. Para cualquier información relativa al producto puede dirigirse a SANTANDER ASSET MANAGEMENT S.A. S.G.I.I.C. (Calle de Serrano nº 69 28006 - MADRID, sociedad gestora de instituciones de inversión colectiva registrada en la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) con el número 12. El Depositario de los fondos es Caceis Bank Spain S.A., Grupo Credit Agricole, (Parque Empresarial La Finca. Paseo Club Deportivo 1-Edificio 4, planta 2. 28223 Pozuelo de Alarcón. Madrid). La inversión en fondos de inversión u otros productos financieros indicados en el presente documento pueden estar sujetos a riesgos de inversión: riesgo de mercado, riesgo de crédito, emisor y contraparte, riesgos de liquidez, riesgos de divisa y, en su caso, riesgos propios de mercados emergentes. Adicionalmente si los fondos materializan sus inversiones en hedge funds, o en activos o fondos inmobiliarios, de materias primas o de private equity, se pueden ver sometidos a los riesgos de valoración y operacionales inherentes a estos activos y mercados así como a riesgos de fraude o los derivados de invertir en mercados no regulados o no supervisados o en activos no cotizados. Las rentabilidades del pasado no son indicativas de resultados en el futuro. Las rentabilidades han sido calculadas en base al valor liquidativo, después de comisiones y anualizadas para los períodos de más de un año. Cualquier mención a la fiscalidad debe entenderse que depende de las circunstancias personales de cada inversor y que puede variar en el futuro. Es aconsejable pedir asesoramiento personalizado al respecto. De la comisión de gestión de cada uno de los fondos, el comercializador y otros intermediarios financieros pueden ser perceptores de hasta un 85% de las mismas, sin que ello suponga ningún coste adicional para el cliente. La información contable o de mercado incluida en esta ficha ha sido recopilada de fuentes que SANTANDER ASSET MANAGEMENT S.A. S.G.I.I.C. considera fiables, aunque no ha confirmado ni verificado su exactitud o que sea completa. SANTANDER ASSET MANAGEMENT S.A. S.G.I.I.C. no asume responsabilidad alguna por el uso de la información contenida en este documento. © SANTANDER ASSET MANAGEMENT S.A. S.G.I.I.C., Todos los derechos reservados.

ALEMANIA - ARGENTINA - BRASIL - CHILE - ESPAÑA - LUXEMBURGO - MÉXICO - POLONIA - PORTUGAL - PUERTO RICO - REINO UNIDO

WWW.SANTANDERASSETMANAGEMENT.ES