



Datos a 30 abril 2020

Política de inversión

Esfera Alquimia Patrimonio FI es un fondo de inversión de estilo alternativo dedicado a la operativa con opciones financieras mediante estrategias income trading. Su objetivo es batir los índices subyacentes operados (índices SP 500 y Russell 2000) en el largo plazo con una volatilidad inferior al 10% a la vez que se ofrece una alta densidad de meses positivos. Su objetivo de rentabilidad neta mensual media es de entre un 1,2% a 1,5%. Se plantean unas pérdidas máximas de aproximadamente un 6 % en el mismo periodo temporal sea cual fuere el escenario de mercado existente. El porcentaje de meses en los que se esperan lograr rendimientos positivos (o no negativos) está en torno al 85-90%. Estas cifras únicamente constituyen una referencia y en ningún momento deben considerarse garantía o compromiso futuro de resultados. De esta forma, el fondo aporta una manera perfecta de diversificación a las carteras de inversión tradicionales pues aporta una alta desc correlación con los mercados de renta variable.

Como medidas de cobertura ante fuertes movimientos del mercado se usan dos tipos de estrategias:

- 1) Estrategias pasivas con opciones netamente compradas, las cuales atienden a resortes cuantitativos sobre el precio y la volatilidad implícita del subyacente.
- 2) Estrategias activas compuestas principalmente por posiciones en futuros. La activación de estos futuros se lleva a cabo mediante algoritmos automáticos.

Gestor



Ángel Jesús Gálvez Gálvez
Gestor Esfera Alquimia Patrimonio FI

Información general

Sdad. Gestora	Esfera Capital Gestión SGIC, S.A.U.
Sdad. depositaria	Santander Securities Services, S.A.
Forma jurídica	Fondo de Inversión
Lugar de registro	ESPAÑA
Fecha de constitución	06/10/2017
Cálculo de valor liquidativo	Diario
ISIN	ES0131462089
Núm. Registro CNMV	4975
Divisas	EURO

Comisiones

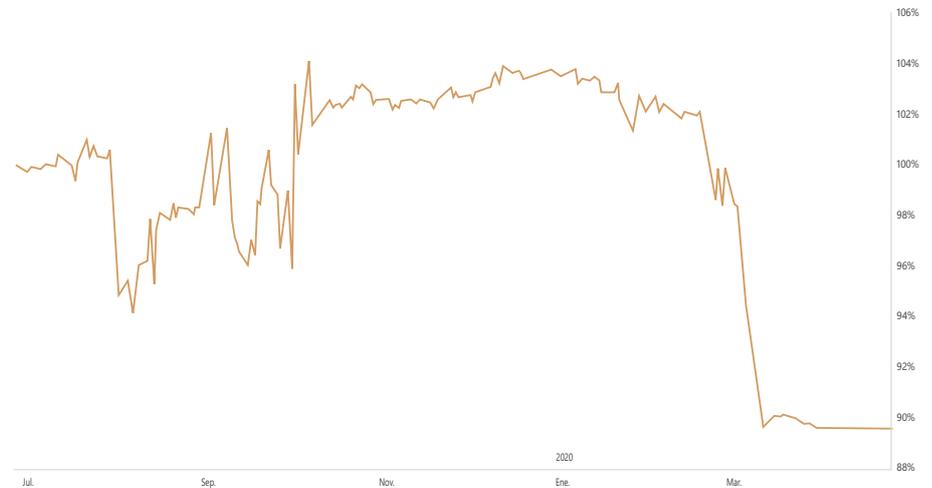
Sobre patrimonio	1,35% (0 – 5M), 1% (5M-25M), 0,8% (>25M)
Sobre resultados	9,00%
Depositaria	0,10%

Perfil de riesgo del fondo

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Esfera Alquimia Patrimonio FI

Evolución del valor liquidativo



Rentabilidades

1 mes	-0,16
Año en curso	-13,65
3 meses	-12,25
6 meses	-12,80
Histórica	-10,49

Volatilidades

1 mes	0,32
Año en curso	10,20
3 meses	11,08
6 meses	8,67
Histórica	14,09

Ratios

Sharpe	-0,72	Sortino	-0,68
--------	-------	---------	-------

Mayores atribuciones

SP 500 INDEX	0,00%	EUR-USD	0,00%
VOLATILITY SP 500 (VIX)	0,00%	RUSSELL 2000 MINI INDEX	0,00%

Distribución divisas



La información resumida de las características de la IIC mostrada en esta pantalla es meramente informativa y puede estar sujeta a modificaciones, por lo que la información válida es exclusivamente la recogida en el Folleto y demás documentación de naturaleza normativa, disponibles en www.esferacapital.es, y en el sitio web www.cnmv.es.

Este documento no constituye una oferta de venta, solicitud de una oferta de compra de ningún producto o servicio de inversión, ni una recomendación o propuesta de inversión personalizada, ni constituye asesoramiento en materia de inversión, ya que en su elaboración no se han tenido en cuenta los conocimientos y experiencia en el ámbito de la inversión correspondiente, o situación financiera o los objetivos de inversión del usuario.

Las inversiones a las que se refieren los contenidos de este documento pueden conllevar riesgos significativos, pueden no ser apropiados para todos los inversores, pudiendo variar y/o verse afectados por fluctuaciones del mercado el valor de los activos que en ellas se mencionan, así como los ingresos que éstos generen, debiendo advertirse que las rentabilidades pasadas no aseguran las rentabilidades futuras.

Esfera Capital Gestión SGIC, S.A. está inscrita en el Registro de la Comisión Nacional de Mercados de Valores (CNMV) con el número 244. Esfera Capital Gestión SGIC, S.A. Calle Velázquez, 50 - Planta 1ª - 28001 - Madrid (ES) - +34 91 825 53 33