



Datos a 31 de enero 2020

### Filosofía de inversión

Esfera Seasonal Quant Multistrategy FI invierte principalmente en los mercados de derivados de materias primas, mediante una estrategia de trading basada en el análisis cuantitativo y estadístico, el análisis fundamental de los subyacentes que se operan y el estudio de las estacionalidades inherentes a cada materia prima. Las estacionalidades son operadas en los mercados de derivados de materias primas mediante spreads con futuros. La gestión se hace invirtiendo simultáneamente en un mismo activo o en activos altamente correlacionados, pero con diferente vencimiento, para operar la diferencia - spread - entre ambos. De esta forma, al no ser direccionales, se pretenden conseguir resultados positivos desde un punto óptimo de riesgo - rentabilidad, en cualquier entorno de mercado. El objetivo es la obtención de resultados ajustados al riesgo, con una baja correlación con los mercados financieros tradicionales, como pueden ser el S&P 500, el Dax 30 y otros índices tanto de renta variable como de renta fija.

### Equipo gestor

**Víctor Hernández**

Gestor Esfera Seasonal Quant Multistrategy, FI.

**Gregory Placsintar**

Asesor Esfera Seasonal Quant Multistrategy, 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	ES0131462097
Núm. Registro CNMV	4975
Divisa	EURO

### Comisiones

Sobre patrimonio	1,35%
Sobre resultados	9%
Depositaria	0,1%

### Perfil de riesgo del fondo

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

## Esfera Seasonal Quant Multistrategy R, FI

### Evolución histórica



### Rentabilidades

	Esfera - Seasonal Quant Multistrategy R FI	Bloomberg Commodity Index
1 mes	1,23	-7,48
3 meses	3,63	-5,55
2020	1,23	-7,48
1 año	5,73	-7,29
Lanzamiento	4,22	-4,82
Ratio Sharpe	0,62	-0,43
Ratio Sortino	0,60	-0,39

Periodos superiores a 1 año en tasa anualizada

### Ratios

Esfera - Seasonal Quant Multistrategy R FI VS Bloomberg Commodity Index	
Alfa	4,41
Beta	-0,05
R <sup>2</sup>	0,69
Treynor	-96,97
Información	67,36

Periodos superiores a 1 año en tasa anualizada

### Principales posiciones en materias primas

WHEAT	-23,22%
KC HRW WHEAT	19,52%
LEAN HOGS	-14,18%
GASOIL	13,28%
BRENT CRUDE	-11,17%

### Mayores atribuciones de la cartera

BRENT CRUDE	1,36%
LEAN HOGS	1,02%
NY HARBOR ULSD HEATING OIL	1,01%
SPDR GOLD TRUST	0,21%
SOYBEAN OIL	0,17%

### Distribución sectorial



### Distribución geográfica



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](http://www.esferacapital.es), y en el sitio web [www.cnmv.es](http://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 1º - 28001 - Madrid (ES) - +34 91 825 53 33