



Filosofía de inversión

Anattea FI Kunié Quant es un fondo multiestrategia y multiactivo cuya gestión se realiza mediante modelos cuantitativos de baja correlación, haciendo uso de algoritmos automáticos.

El objetivo principal de los modelos es gestionar un fondo de baja correlación con el mercado y una volatilidad inferior al 10%, generando retornos positivos con independencia del escenario de mercado.

El fondo utilizará la diversificación como motor principal de rentabilidad ajustada al riesgo, diversificando en activos, estrategias y temporalidad de cada inversión consiguiendo así desvincular el rendimiento del fondo con el comportamiento del mercado.

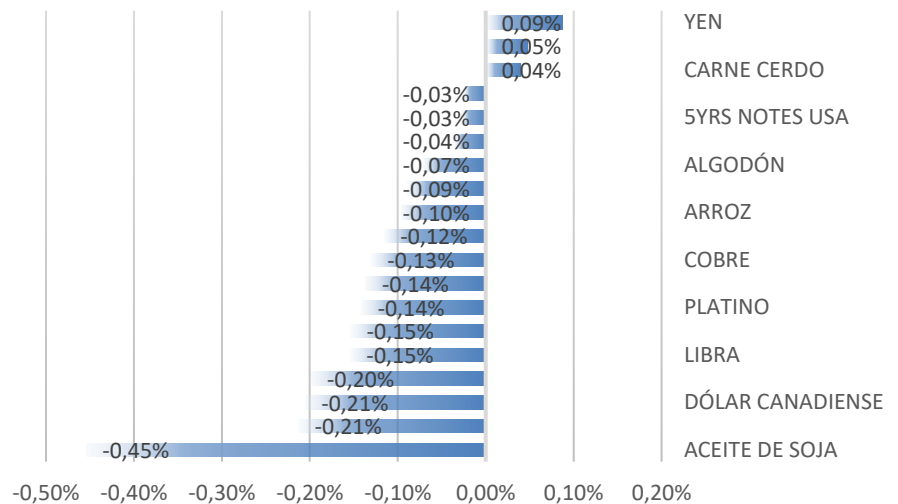
Las principales fuentes de descorrelación son la descorrelación entre los activos en cartera y descorrelación entre las estrategias subyacentes.

No existe predeterminación en cuanto a la distribución de la cartera.

Características

ISIN	ES0109204000
Divisa	Euro
Comisiones	
Gestión	1,35%
Resultados	9%
Depósito	0.08%
Ticker Bloomberg	ANAKUNQ:SM
Categoría	Retorno Absoluto
Plataforma	Inversis
TER	1.56%

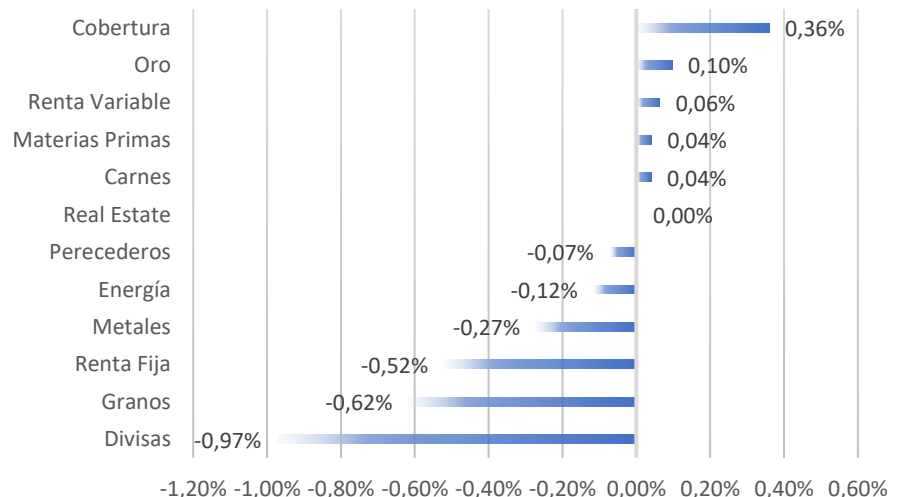
Rentabilidad por activo. Diciembre 2019.



Ratios

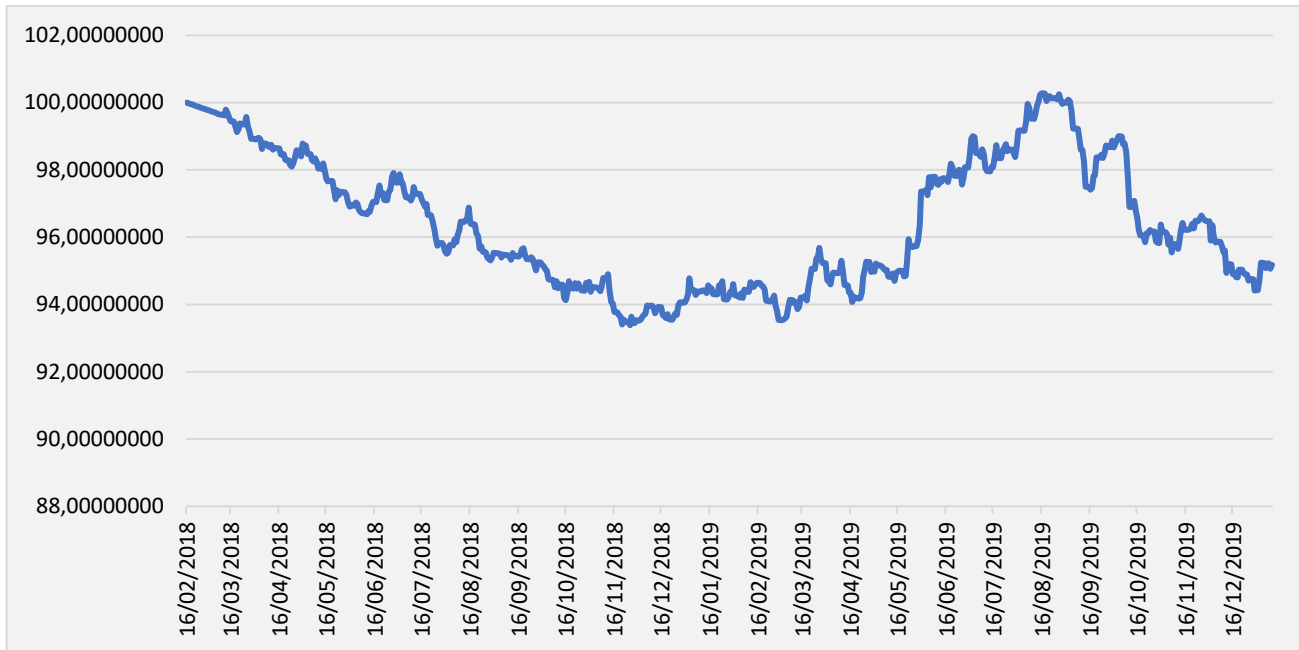
Volatilidad Máxima	< 10%
Ratio de Sharpe	> 1
Correlación S&P 500 YTD	- 0.22
Correlación Intraportfolio(Q)	0.3

Rentabilidad por familia de activo. Diciembre 2019.





Histórico



	Kunié Quant	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	YTD
2018	Rentabilidad		-0.20%	-0.89%	-0.52%	-1.51%	0.74%	-2.09%	-0.04%	-0.29%	-0.60%	-1.21%	0.57%	-5.94%
	Volatilidad		0.07%	1.68%	1.73%	2.54%	2.44%	2.33%	2.81%	2.10%	3.04%	3.26%	2.13%	2.82%

	Kunié Quant	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	YTD
2019	Rentabilidad	0.58%	-0.84%	1.51%	-0.16%	2.41%	0.74%	0.65%	1.32%	-1.14%	-2.51%	0.09%	-2.13%	0.39%
	Volatilidad	3.57%	2.34%	3.50%	4.90%	4.90%	4.00%	4.59%	3.27%	4.77%	5.07%	3.38%	4.43%	4.14%

Este documento no sustituye al DFI (Datos Fundamentales Inversor), que deberá ser consultado con carácter previo a cualquier decisión de inversión, suscripción/compra o desinversión.

(*) El equipo gestor puede hacer uso de instrumentos derivados en el proceso de inversión, tomando posiciones en largo y corto basadas en su visión del mercado, estando des-correlacionado el comportamiento del fondo con los movimientos producidos en el mercado de renta fija y renta variable. Tomando posiciones en corto el fondo puede obtener retornos positivos en caso de caídas en los mercados, por el contrario, se podrían producir pérdidas en caso de subida del subyacente. El DFI y el folleto registrado/autorizado por la CNMV estará disponible en la página web www.anattea.com