

## Attitude Global FENWAY FIL

### Comentario del Gestor

Febrero ha sido un mes en que los mercados han seguido ponderando un escenario central extremadamente positivo en nuestra opinión. Pendientes de curva extremadamente negativas, descontando una recesión que provocará, más pronto que tarde, una recesión ligera pero suficiente para forzar a la baja la inflación y los tipos de interés. Y todo ello sin afectar a márgenes y beneficios empresariales.

El fondo está posicionado con coberturas de vencimiento hasta junio con put spreads que amortiguarían el efecto de una caída relevante desde los niveles actuales. La cartera sigue su política de inversión en acciones de calidad (baja deuda, generadoras de caja, sectores no cíclicos y buena posición competitiva) con múltiplos atractivos. No ha habido nuevas incorporaciones durante el mes.

En el caso de la renta fija hemos seguido incorporando pagarés emitidos por empresas fiables con vencimientos por debajo de un año con rentabilidades medias del 3.5%. En un mes, vencerán algunos de ellos que, en función de las condiciones de mercado, podríamos reinvertir en duraciones más altas, pero no más allá de los cinco años.

### Perfil

|  |
|--|
| Fondo de Retorno Absoluto                      |
| Posiciones oportunistas en activos financieros |
| Posiciones estructurales en gestores externos  |
| Sin Apalancamiento                             |
| Aproximación medio plazo                       |

### Evolución del NAV



(\*) Rentabilidades pasadas no son garantía de futuras ganancias.

### Datos del Fondo

|                          |                                   |
|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Valor Liquidativo</b> | <b>10,29 € (a 28.02.23)</b>       |
| Patrimonio               | 77,86 € mil.                      |
| Liquidez                 | Diaria                            |
| Divisa                   | EUR                               |
| Fecha Inicio             | 22-dic-16                         |
| ISIN                     | ES0111174019                      |
| Ticker Bloomberg         | ATTFNWF SM Equity                 |
| Comisión Depositaria     | 0,08% anual                       |
| Sociedad Gestora         | Attitude Gestión, SGIC            |
| Entidad Depositaria      | Caceis Bank Spain, S.A            |
| Auditor                  | KPMG Auditores                    |
| Inversión Mínima         | 100.000 € (excepto profesionales) |

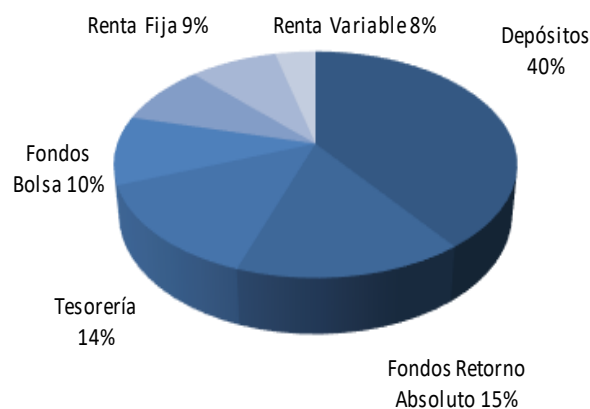
### Análisis de Rentabilidad

|                                      |        |
|--------------------------------------|--------|
| Rentabilidad desde Inicio*           | 2,87%  |
| Rentabilidad Anualizada desde Inicio | 7,83%  |
| Rentabilidad Año en Curso            | 2,68%  |
| Rentabilidad Último Mes              | 0,59%  |
| Porcentaje de meses en positivo      | 66,67% |

### Análisis de Riesgos

|                          |         |
|--------------------------|---------|
| Volatilidad              | 2,26%   |
| VaR medio mensual 99% 1d | 1,02%   |
| Ratio Sharpe             | 2,4891  |
| Máximo Drawdown Mensual  | - 0,18% |

### Distribución de la cartera



# Attitude Global FENWAY FIL

## Rentabilidades Mensuales Históricas (\*)

| (%)  | Enero | Febrero | Marzo | Abril | Mayo | Junio | Julio | Agosto | Septiemb. | Octubre | Noviemb. | Diciemb. | Año   |
|------|-------|---------|-------|-------|------|-------|-------|--------|-----------|---------|----------|----------|-------|
| 2022 |       |         |       |       |      |       |       |        |           | -0,18   | 0,14     | 0,23     | 0,19% |
| 2023 | 2,07  | 0,59    | --    | --    | --   | --    | --    | --     | --        | --      | --       | -        | 2,68% |

El valor del patrimonio en un fondo de inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeto a las fluctuaciones de los mercados, pudiendo obtenerse tanto rendimientos positivos como pérdidas. Rentabilidades pasadas no son garantía de futuras ganancias. Información estrictamente privada y confidencial.

## Distribución del resultado

| Tipo de Activo | P&G Mes     | P&G Año      |
|----------------|-------------|--------------|
| Renta Variable | 95.774,36   | 437.853,96   |
| Renta Fija     | 18.754,09   | 60.403,64    |
| Futuros        | 154.944,78  | 264.796,24   |
| Opciones       | (18.700,76) | (104.582,17) |
| Fondos         | 141.668,97  | 1.131.223,19 |
| Comisiones     | (86.929,40) | (268.737,36) |
| Intereses      | 57.723,10   | 96.089,89    |
| Total          | 363.235,14  | 1.617.047,39 |

**Aviso Importante:** El presente documento ha sido elaborado por Attitude Gestión, S.G.I.I.C., S.A. ("Attitude") con la finalidad de proporcionar información sobre la evolución de cartera del fondo en el periodo de referencia. Bajo ninguna circunstancia podrá entenderse que este documento constituye: (i) una oferta de compra, venta, suscripción o negociación de los instrumentos financieros en él mencionados; (ii) una recomendación personalizada de inversión, y/o; (iii) una recomendación general relativa a operaciones sobre los instrumentos financieros en él mencionados (informes de inversiones y análisis financiero). La información contenida ha sido recopilada de buena fe y de fuentes que consideramos fiables, pero no garantizamos la exactitud de la misma, la cual puede ser incompleta o presentarse condensada.

Cualquier decisión de inversión deberá tener en cuenta toda la información pública existente sobre el fondo de referencia, especialmente la documentación registrada en la Comisión Nacional del Mercado de Valores y disponible en el domicilio de la SGIIC del fondo (Attitude Gestión SGIIC SA, calle Orense 68, Planta 11 - 28020 Madrid). Attitude Gestión SGIIC no reconoce ninguna responsabilidad sobre las decisiones de inversión que se pudieran adoptar atendiendo a la información contenida en el presente documento, cuyo riesgo corresponderá exclusivamente a la persona que adopte las mismas. Los contenidos y productos incluidos en este documento no están concebidos, ni dirigidos a aquellas personas que residan en jurisdicciones donde sus contenidos no se encuentren autorizados, incluidos los Estados Unidos de América. Este fondo no tiene garantía de un tercero por lo que ni el capital invertido ni la rentabilidad están garantizados. Este fondo puede no ser adecuado para inversores que prevean retirar su dinero en un plazo de antes de 3 años. Las inversiones descritas pueden conllevar, entre otros, un riesgo del mercado de renta variable, de tipo de interés, de tipo de cambio, de crédito, así como de inversión en países emergentes. El uso de instrumentos derivados, incluso como cobertura de las inversiones de contado, también conlleva riesgos, como la posibilidad de que haya una correlación imperfecta entre el movimiento del valor de los contratos de derivados y los elementos objeto de cobertura, lo que puede dar a lugar a que esta no tenga todo el éxito previsto. Como consecuencia, el valor liquidativo del fondo puede presentar una alta volatilidad.

Attitude Global FIL está inscrito en el Registro Oficial de la Comisión Nacional del Mercado de Valores ([www.cnmv.es](http://www.cnmv.es)) con el número 59. Attitude Gestión, S.G.I.I.C. S.A. es una sociedad gestora de instituciones de inversión colectiva inscrita el 12 de Febrero de 2016 en el Registro de la CNMV de sociedades gestoras de instituciones de inversión colectiva con el número 246. La transformación a sociedad gestora de Attitude Gestión, S.G.I.I.C., S.A. fue inscrita en el Registro Mercantil de Madrid el 8 de febrero de 2016 en el tomo 33.640, folio 82, sección 8, hoja M-512469.

El valor del patrimonio en un fondo de inversión, cualquiera que sea su política de inversión, está sujeto a las fluctuaciones de los mercados, pudiendo obtenerse tanto rendimientos positivos como pérdidas. Rentabilidades pasadas no son garantía de futuras ganancias. Información estrictamente privada y confidencial.