

CARACTERÍSTICAS DE LA SICAV

Fecha de Constitución:	9-jul-06
Patrimonio en miles Euros [a 31/10/12]:	9,830
Número de Partícipes [a 31/10/12]:	293
Valor Liquidativo [a 31/10/12]:	10,5483
Entidad Gestora:	Solventis A.V., S.A.
Gestor:	Christian Torres / Xavier Brun
Entidad Depositaria:	RBC IS España
Entidad Auditora:	PriceWaterhouseCoopers
Entidad Administradora:	RBC IS Activos
Código ISIN / Bloomberg:	ES0130123039 / S3118 SM
Mercado de cotización:	Mercado Alternativo Bursátil
Enlace web Gestora:	www.solventis.es

COMISIONES

Comisión de Gestión (sobre Patrimonio):	1,35%
Comisión de Depósito (sobre Patrimonio):	0,10%
Comisión sobre Beneficios (tasa de corte anual):	9,00%

ESTADÍSTICAS

Rentabilidad		Riesgo	
Valor Liquidativo:	Diario	Marco Regulatorio:	UCITS
septiembre 2012:	-0,23%	Sharpe (Euribor12m):	0,19
Acumulada Año 2012:	6,98%	Alpha (12m):	0,65
12 Últ. Meses:	4,30%	Treynor (12m):	0,05
Total desde Inicio:	5,48%	Sortino (12m):	0,32
Rent. Hist Anualizada:	0,85%	Tracking Error [12m]:	0,01
Rent. Mensual Media:	0,16%	Information Ratio	-1,04
Mayor Subida Mensual:	12,76%	Coef. Determinación	0,84
Mayor Caída Mensual:	-12,81%	Asimetría:	-0,10
% Meses en Positivo:	53,95%	Curtosis:	2,03
Volatilidad [12m]:	15,97%	Fund 1D (max 33%):	>95%
Beta [12m]:	0,64	VaR 1d [99%]:	2,58%

RENTABILIDADES (*) Desde inscripción

Año	Solventis EOS	Euro stoxx 50	Dif.
2012	7,0%	8,1%	-1,1%
2011	-17,9%	-17,1%	-0,9%
2010	9,0%	-5,8%	14,8%
2009	20,4%	21,1%	-0,8%
2008	-25,8%	-44,4%	18,6%
2007	0,2%	6,8%	-6,6%
2006(*)	23,1%	12,8%	10,3%
Total	5,5%	-31,4%	36,9%
Anual (TAE)	0,8%	-5,8%	5,1%

PRINCIPALES VALORES

Lenzing AG	4,44%
Statoilhydro Asa (GY)	4,22%
Valeo SA	4,11%
Total Fina	4,02%
Siemens AG-REG	3,75%
RWE AG	3,62%
Deutz AG	3,47%
AP Moller Maersk A/S	3,32%
Leoni Ag	3,02%

PRINCIPALES SECTORES

Industrial	22,3%
Farmacia, Química y Biotecnología	16,0%
Transporte	15,8%
Recursos Básicos	13,1%
Energía y Petróleo	11,7%
Agua, Gas y Electricidad	3,6%
Telecomunicaciones	3,5%
Consumo No Cíclico	3,0%
Deuda Estado	2,3%

Solventis EOS, SICAV

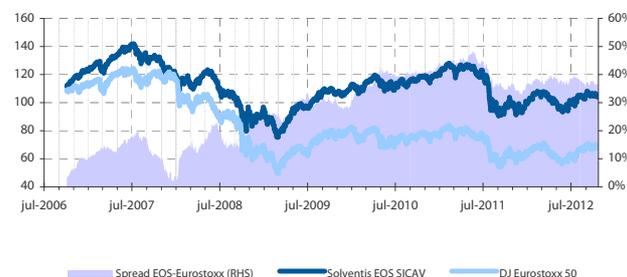
	Ene.	Feb.	Mar.	Abr.	May.	Jun.	Jul.	Ago.	Sep.	Oct.	Nov.	Dic.	Año
2012	5,2%	3,8%	-1,3%	-3,0%	-6,7%	3,7%	3,5%	1,1%	1,3%	-0,2%	-	-	7,0%
2011	4,0%	2,1%	-2,1%	2,3%	-0,6%	-3,2%	-5,8%	-12,8%	-5,3%	5,7%	-2,1%	-0,4%	-17,9%
2010	0,4%	-0,0%	5,2%	0,6%	-3,4%	-1,6%	3,3%	-1,5%	2,5%	2,8%	-3,6%	4,4%	9,0%
2009	-3,6%	-9,0%	1,3%	12,8%	6,5%	-0,1%	4,5%	4,7%	2,7%	-2,1%	-1,5%	4,3%	20,4%
2008	-6,1%	1,1%	-2,3%	5,1%	2,4%	-6,9%	-6,4%	0,3%	-8,0%	-7,6%	-0,2%	0,3%	-25,8%
2007	2,8%	-0,5%	2,7%	3,2%	4,7%	0,4%	-1,1%	-2,0%	-2,6%	0,9%	-5,8%	-2,0%	0,2%
2006(*)	-	-	-	-	-	-	2,5%	2,1%	5,4%	5,5%	2,8%	2,9%	23,1%

DJ Eurostoxx 50

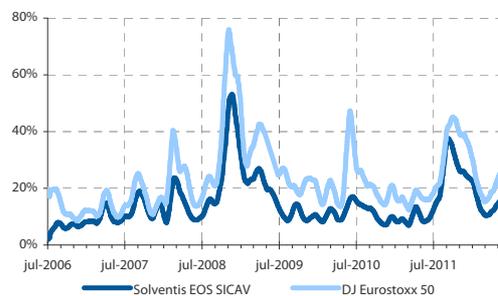
	Ene.	Feb.	Mar.	Abr.	May.	Jun.	Jul.	Ago.	Sep.	Oct.	Nov.	Dic.	Año
2012	4,3%	3,9%	-1,4%	-6,9%	-8,1%	6,9%	2,7%	4,9%	0,6%	2,0%	-	-	8,1%
2011	5,8%	2,0%	-3,4%	3,4%	-5,0%	-0,5%	-6,3%	-13,8%	-5,3%	9,4%	-2,3%	-0,6%	-17,1%
2010	-6,3%	-1,7%	7,4%	-3,9%	-7,3%	-1,4%	6,6%	-4,3%	4,8%	3,5%	-6,8%	5,4%	-5,8%
2009	-8,6%	-11,7%	4,8%	14,7%	3,2%	-2,0%	9,8%	5,2%	3,5%	-4,5%	2,0%	6,0%	21,1%
2008	-13,8%	-1,8%	-2,6%	5,4%	-1,2%	-11,3%	0,4%	-0,1%	-9,7%	-14,7%	-6,2%	0,7%	-44,4%
2007	1,4%	-2,2%	2,3%	5,1%	2,7%	-0,5%	-3,9%	-0,5%	2,0%	2,5%	-2,1%	0,1%	6,8%
2006(*)	-	-	-	-	-	-	1,2%	3,2%	2,4%	2,7%	-0,4%	3,3%	12,8%

(*) Desde inscripción

EVOLUCIÓN RENTABILIDAD EOS vs. SX5E



EVOLUCIÓN VOLATILIDAD EOS vs. SX5E



SOLVENTIS A.V., S.A. inscrita en el Registro de Empresas de Inversión de CNMV con el nº 244. Este documento no constituye una oferta o recomendación para la adquisición o venta, o para realizar cualquier transacción. Ninguna información contenida en el presente informe debe interpretarse como asesoramiento o consejo y debe considerarse como opiniones de la Gestora que son susceptibles de cambio. La información contenida en la presente comunicación hace o puede hacer referencia a rendimientos pasados o a datos sobre rendimientos pasados o a datos sobre rendimientos financieros, índices financieros, medidas financieras o servicios de inversión, en consecuencia, los destinatarios de la misma están advertidos de que dichas referencias a rendimientos pasados no son ni pueden servir, como indicador fiable de posibles resultados futuros, ni como garantía de alcanzar tales resultados.