

Cistella Sigma Multiactius

Perfil de Risc :

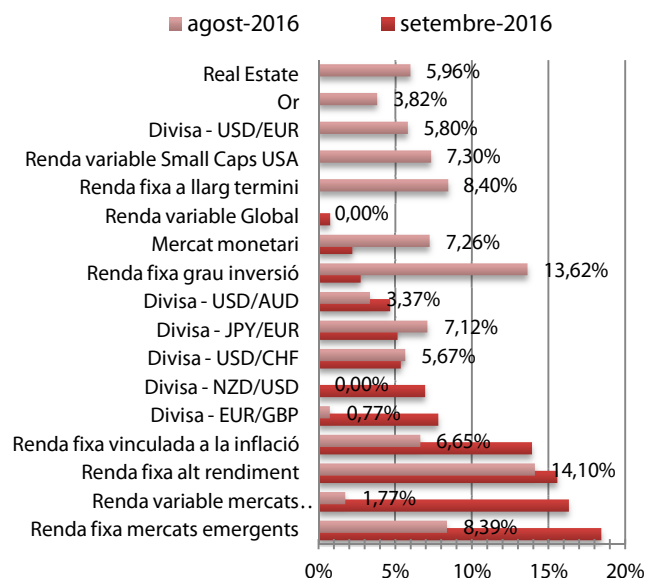
Filosofia d'inversió

Modalitat d'inversió integrada en el Pla d'Estalvi Multiversió, que permet participar a través del fons DIP Client Risk 3, en una cistella de fons d'inversió, que inverteixen en una amplia gamma d'actius financers (renda fixa, renda variable, matèries primeres, divises, inflació, or, Real Estate).

L'objectiu de la cistella és la obtenció d'una rendibilitat positiva a mig i llarg termini, amb preservació del capital i amb independència de la evolució dels mercats financers. Per a la consecució d'aquest objectiu, s'aplica una metodologia d'inversió quantitativa que controla i redueix el risc o volatilitat, a través d'un elevat grau de diversificació i una baixa correlació eficient amb la resta d'actius i amb els mercats financers. Aquest objectiu de rendibilitat positiva no està garantit.


Principals posicions de la cistella i gràfic de variació de la distribució d'actius

Nom del fons d'inversió	Ponderació a la cistella
Natixis Harris Associates Global Equity Fund	0,78%
Robeco Emerging Stars Equities Class D USD	7,90%
PIMCO Global Investors Real Return Fund E	10,00%
MFS® Meridian Funds - Emerg Mkts Debt	9,36%
Pictet-Emerging Markets Index P USD	8,41%
AXA WF Global Inflation Bonds Capitalisation	3,92%
PIMCO Global Investment Grade Credit Acc	2,77%
AXA WF Global High Yield Bonds Capitalisat.	7,88%
Goldman Sachs Global High Yield Portfolio	7,69%
BNY Mellon Emerg Mkts Debt Local Currency	9,06%
La Française Trésorerie I	2,22%
Compra futurs D. neozelandés/Dólar U.S.A.	6,96%
Compra futurs Euro/Libra esterlina	7,82%
Venta futurs Yen japonés/Euro	5,16%
Venta futurs Dólar U.S.A./Dólar australiano	4,69%
Venta futurs Dólar U.S.A./Franco suïzo	5,37%


Evolució històrica del valor liquidatiu (10,155917 a 30-09-2016)


	Any 2008	Any 2009	Any 2010	Any 2011	Any 2012	Any 2013	Any 2014	Any 2015	Any 2016
Rendibilitat:	2,87%	19,28%	6,37%	1,64%	5,33%	5,30%	2,67%	3,16%	3,15%
Volatilitat / Risc:	4,44%	3,35%	4,70%	4,55%	3,49%	3,73%	3,40%	3,27%	2,26%

Rendibilitats mensuals

	Gener	Febr.	Març	Abril	Maig	Juny	Juliol	Agost	Set.	Oct.	Nov.	Des.	Any
2016	+0,12%	+0,38%	+0,84%	+0,91%	-0,80%	+1,65%	+0,43%	-0,33%	-0,07%				+3,15%
2015	+3,09%	+1,02%	+0,92%	-0,32%	+0,39%	-0,79%	+0,38%	-1,18%	-0,23%	+0,31%	+0,32%	-0,73%	+3,16%
2014	-1,06%	+1,61%	+0,31%	-0,26%	+0,13%	+1,01%	+0,42%	+0,59%	-1,73%	+0,73%	+0,95%	+0,22%	+2,67%
2013	+1,62%	+1,06%	+2,30%	+2,80%	-2,36%	-1,11%	+0,84%	-0,96%	+0,63%	+0,32%	-0,13%	+0,27%	+5,30%
2012	+1,11%	+0,68%	+0,66%	-0,43%	-2,66%	-0,43%	+1,91%	-0,17%	+0,92%	+0,26%	+1,01%	+2,44%	+5,33%

Rendibilitats mensuals anteriors al desembre de 2014 calculades segons *backtesting*, sota la hipòtesi d'haver aplicat l'actual mètode d'inversió de la cistella en el passat.