

Cistella Sigma Multiactius

Perfil de Risc : ★★☆☆

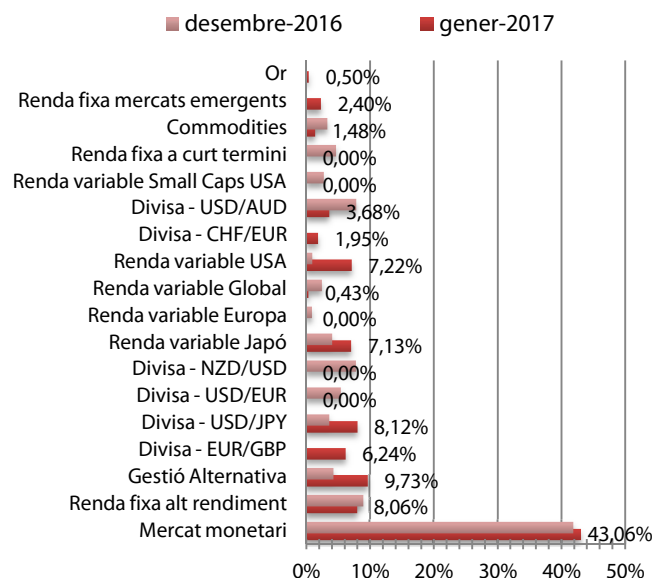
Filosofia d'inversió

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
BlackRock Global Funds - World Gold Fund	0,50%
Robeco BP US Large Cap Equities DH EUR	7,22%
Julius Baer Commodity Fund EUR	1,48%
Schroder Int. Selection Fund Japanese Equity	7,13%
AXA IM Euro Liquidity	10,00%
Candriam Money Market Euro I Acc EUR	10,00%
Groupama Entreprises IC	10,00%
AXA WF Global High Yield Bonds Capitalisat.	4,10%
Goldman Sachs Global High Yield Portfolio	3,96%
Old Mutual Global Equity Absolute Return	9,73%
La Française Trésorerie I	10,00%
MFS® Meridian - Emerging Markets Debt Fund	2,39%
Compra futurs Euro /Lliura esterlina	6,24%
Venda futurs Dòlar U.S.A./Yen japonès	8,12%
Venda futurs Dòlar U.S.A./Dòlar australià	3,68%
Venda futurs Francs suïssos/Euro	1,95%


Evolució històrica del valor liquidatiu (9,993527 a 31-01-2017)


	Any 2009	Any 2010	Any 2011	Any 2012	Any 2013	Any 2014	Any 2015	Any 2016	Any 2017
Rendibilitat:	19,28%	6,37%	1,64%	5,33%	5,30%	2,67%	3,16%	1,97%	-0,46%
Volatilitat / Risc:	3,35%	4,70%	4,55%	3,49%	3,73%	3,40%	3,27%	2,45%	2,42%

Rendibilitats mensuals

	Gener	Febr.	Març	Abril	Maig	Juny	Juliol	Agost	Set.	Oct.	Nov.	Des.	Any
2017	-0,46%												-0,46%
2016	+0,12%	+0,38%	+0,84%	+0,91%	-0,80%	+1,65%	+0,43%	-0,33%	-0,07%	-0,10%	-2,01%	+0,99%	+1,97%
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%

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.