

Cistella Sigma Multiactius

Perfil de Risc :

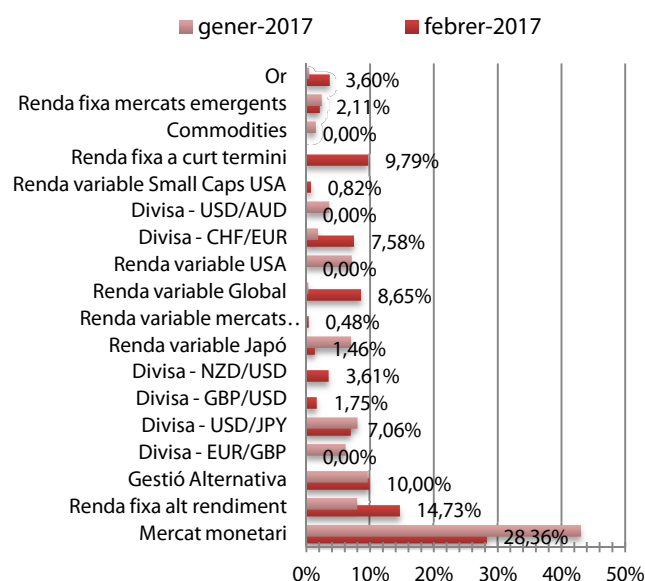
Filosofia d'inversió

Modalitat d'inversió integrada en el Pla d'Estalvi Multinversió, que permet participar a través del fons DIP Client Risk 3, en una cistella de fons d'inversió, que inverteixen en una ampla 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	2,75%
Natixis Harris Associates Global Equity Fund	8,65%
Fidelity Funds - Global High Grade Income A	5,66%
Schroder Int. Selection Fund Japanese Equity	1,46%
AXA IM Euro Liquidity	8,36%
Candriam Money Market Euro I Acc EUR	10,00%
BlackRock GF-Euro Short Duration Bond Fund	4,13%
AXA WF Global High Yield Bonds Capitalisat.	7,32%
Goldman Sachs Global High Yield Portfolio	7,41%
Old Mutual Global Equity Absolute Return	10,00%
La Française Trésorerie I	10,00%
MFS® Meridian - Emerging Markets Debt Fund	2,11%
Compra futurs Libra esterlina/ Dólar USA	1,75%
Venta futurs Dólar U.S.A./Yen japonés	7,06%
Compra futurs Dólar neozelandés/Dólar USA	3,61%
Venta futurs Francos suïços/Euro	7,58%


Evolució històrica del valor liquidatiu (10,004726 a 28-02-2017)


	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%	-0,35%
Volatilitat / Risc:	3,35%	4,70%	4,55%	3,49%	3,73%	3,40%	3,27%	2,45%	2,37%

Rendibilitats mensuals

	Gener	Febr.	Març	Abril	Maig	Juny	Juliol	Agost	Set.	Oct.	Nov.	Des.	Any
2017	-0,46%	+0,11%											-0,35%
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.