

Cistella Sigma Multiactius

Perfil de Risc :

Filosofia d'inversió

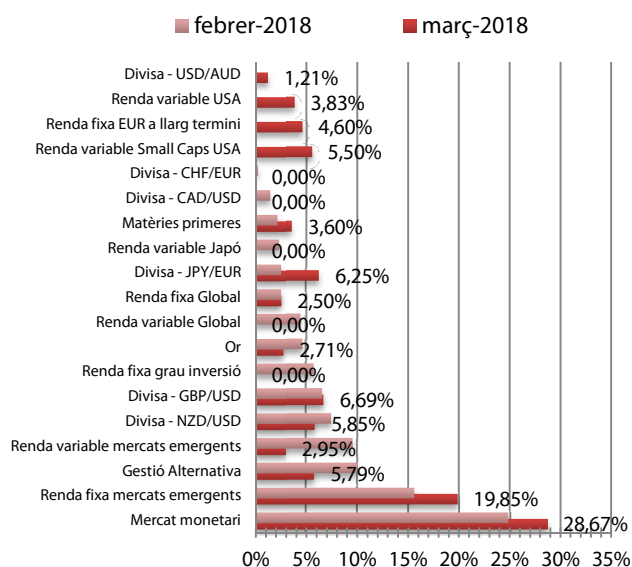
Modalitat d'inversió integrada al Pla d'Estalvi Multiversió, assegurança d'estalvi on el subscriptor assumeix el risc de la inversió, i que permet participar, a través del fons DIP Client Risk 3, en una cistella de fons d'inversió que inverteix en una ampla gamma d'actius financers (renda fixa, renda variable, matèries primeres, divises, inflació, or i Real Estate).

L'objectiu de la cistella és la obtenció d'una rendibilitat positiva a mig i llarg termini, preservant el capital i amb independència de la evolució dels mercats financers. Per assolir 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
Vontobel Fund - Commodity H	3,60%
T. Rowe Price - US Smaller Companies Equity	5,50%
Groupama Entreprises IC	4,33%
La Française Trésorerie I	7,50%
Neuberger Berman Emerging Markets DebtLC	9,85%
Schroder Selection Fund Emerging Markets	2,95%
Amundi S.F. - Euro Curve 7-10 year A EUR	4,61%
Pictet-Emerging Local Currency Debt	10,00%
ETFS Physical Gold	2,71%
Old Mutual Global Equity Absolute Return	5,79%
JPMorgan Funds - Global Government Bond	2,50%
AXA IM Euro Liquidity	6,84%
Venda futurs Ien japonès / Euro	6,25%
Compra futurs Dòlar neozelandès / Dòlar USA	5,85%
Compra futurs Lliura esterlina / Dòlar USA	6,69%


Evolució històrica del valor liquidatiu (10,242463 a 31-03-2018)


	Any 2010	Any 2011	Any 2012	Any 2013	Any 2014	Any 2015	Any 2016	Any 2017	Any 2018
Rendibilitat:	6,37%	1,64%	5,33%	5,30%	2,67%	3,16%	1,97%	2,51%	-0,48%
Volatilitat / Risc:	4,70%	4,55%	3,49%	3,73%	3,40%	3,27%	2,45%	2,34%	2,57%

Rendibilitats mensuals

	Gener	Febr.	Març	Abril	Maig	Juny	Juliol	Agost	Set.	Oct.	Nov.	Des.	Any
2018	+1,11%	-1,21%	-0,36%										-0,48%
2017	-0,46%	+0,11%	-0,40%	+0,92%	+0,80%	-0,59%	+1,61%	+0,60%	-0,03%	+0,06%	+0,28%	-0,40%	+2,51%
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%

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.