

Cistella Sigma Multiactius

Perfil de Risc :

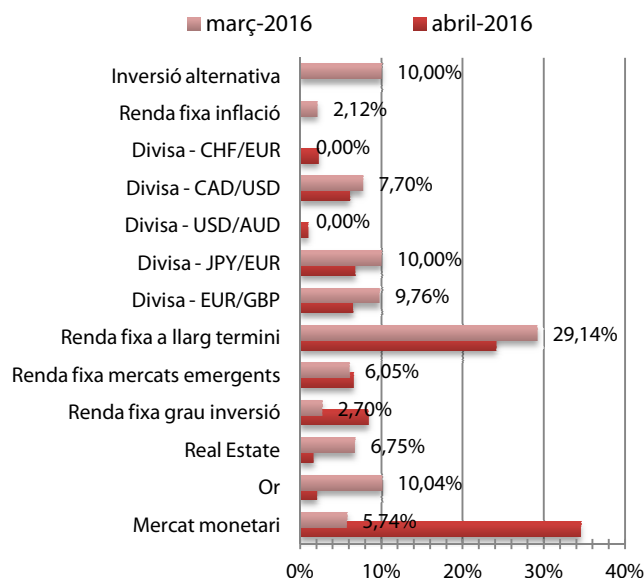
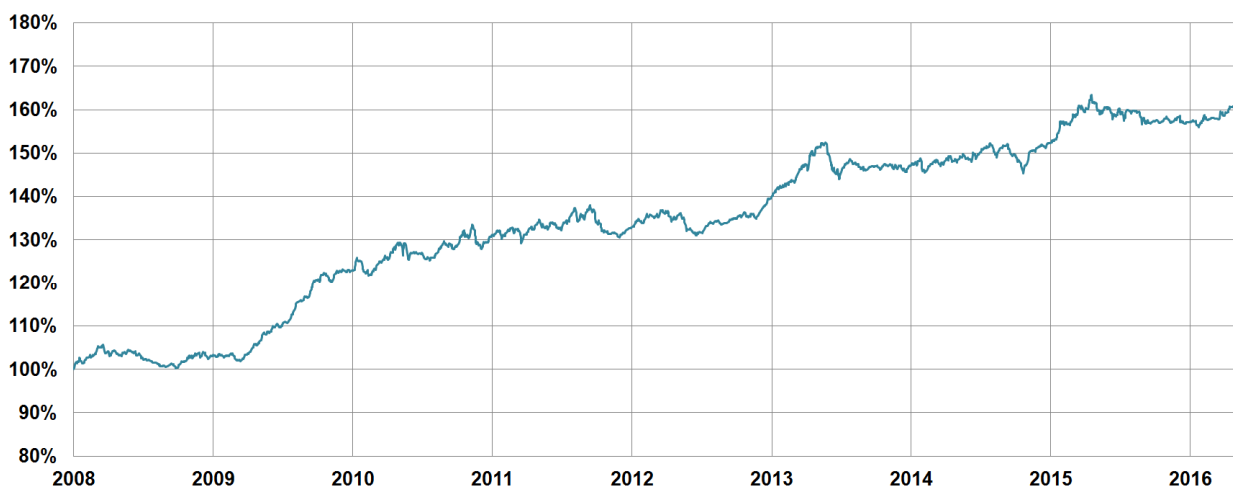
Filosofia d'inversió

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 per distribució d'actius

Nom del fons d'inversió	Ponderació a la cistella
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity	1,25%
Henderson Horizon - Global Property Equities	3,62%
BlackRock Global Funds - World Gold Fund A2	3,91%
ETFS Physical Gold (USD)	3,63%
JPMorgan Funds Global Government Bond A	7,51%
AXA World Funds Euro 7-10 A Capitalisation	9,00%
PIMCO Global Investment Grade Credit Acc	7,71%
Morgan Stanley IF Global Credit Fund Z	6,72%
AXA WF Global High Yield Bonds Capitalisat.	8,36%
Goldman Sachs Global High Yield Portfolio	5,62%
BNY Mellon Emerg Mkts Debt Local Currency	6,85%
MFS® Meridian Fds - Emerging Markets Debt	1,55%
Candriam Money Market Euro I Acc EUR	4,27%
Compra futurs Euro/Lliura esterlina	10,00%
Venda futurs Ien japonès/Euro	6,90%
Venda futurs Dòlar U.S.A./dòlar australià	3,58%
Compra futurs dòlar canadenc/Dòlar U.S.A.	9,52%


Evolució històrica del valor liquidatiu segons backtesting (sota la hipòtesi d'haver aplicat l'actual mètode d'inversió de la cistella en el passat)


	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%	2,26%
Volatilitat / Risc:	4,44%	3,35%	4,70%	4,55%	3,49%	3,73%	3,40%	3,27%	2,95%

Rendibilitats mensuals segons backtesting (sota la hipòtesi d'haver aplicat l'actual mètode d'inversió de la cistella en el passat)

	Gener	Febr.	Març	Abril	Maig	Juny	Juliol	Agost	Set.	Oct.	Nov.	Des.	Any
2016	+0,12%	+0,38%	+0,84%	+0,91%	+0,39%	-0,79%	+0,38%	-1,18%	-0,23%	+0,31%	+0,32%	-0,73%	+2,26%
2015	+3,09%	+1,02%	+0,92%	-0,32%	+0,13%	+1,01%	+0,42%	+0,59%	-1,73%	+0,73%	+0,95%	+0,22%	+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%	+6,67%
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%