

Cesta Sigma Multiactivos

Perfil de Riesgo: ☆☆☆☆

Filosofía de inversión

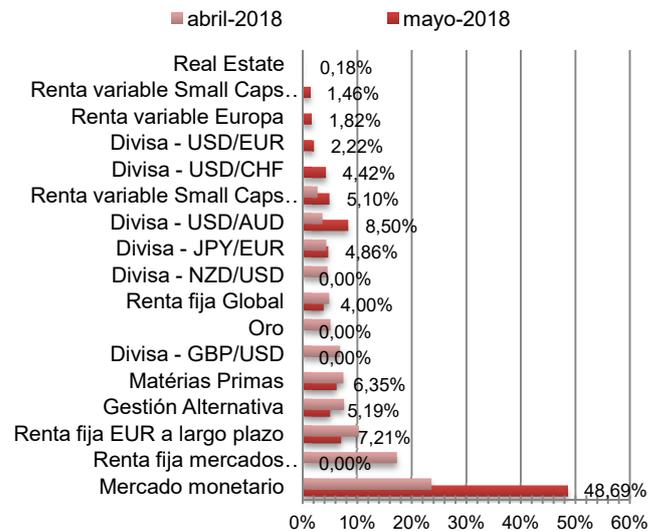
Modalidad de inversión incluida en el Plan de Ahorro Multinversión, que permite participar a través del fondo DIP Client Risk 3, en una cesta de fondos de inversión que invierte en un amplio abanico de activos financieros (renta fija, renta variable, materias primas, divisas, inflación, oro y Real Estate).

El objetivo de la cesta es la obtención de una rentabilidad positiva a medio y largo plazo, con preservación del capital y con independencia de la evolución de los mercados financieros. Para la consecución de dicho objetivo, se aplica una metodología de inversión cuantitativa que controla y reduce el riesgo o volatilidad a través de un elevado grado de diversificación y una baja correlación eficiente con el resto de activos y con los mercados financieros. Este objetivo de rentabilidad positiva no está garantizado.



Principales posiciones de la cesta y gráfico de variación de la distribución de activos

| Nombre del fondo de inversión | Ponderación en la cesta |
|--|-------------------------|
| Vontobel Fund - Commodity H | 6,35% |
| Fidelity Funds - Global Short Duration Income | 4,00% |
| Groupama Entreprises IC | 10,00% |
| La Française Trésorerie I | 10,00% |
| T. Rowe Price Funds SICAV - US Smaller Companies Equity Fund | 1,46% |
| G Fund Avenir Europe IC | 5,10% |
| Amundi S.F. - Euro Curve 7-10 year A EUR | 7,21% |
| Invesco Pan European Equity | 1,82% |
| AXA IM Euro Liquidity | 10,00% |
| Old Mutual Global Equity Absolute Return | 5,19% |
| Aviva Investors Monétaire E | 6,51% |
| AXA IM Euro Liquidity | 10,00% |
| Amundi Funds - Cash EUR AE-C | 10,00% |
| Venta futuros Yen japonés / Euro | 4,86% |
| Venta futuros Dólar USA / Euro | 2,22% |



Evolución histórica del valor liquidativo (10,006216 a 31-05-2018)



| | Año 2010 | Año 2011 | Año 2012 | Año 2013 | Año 2014 | Año 2015 | Año 2016 | Año 2017 | Año 2018 |
|-----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Rentabilidad: | 6,37% | 1,64% | 5,33% | 5,30% | 2,67% | 3,16% | 1,97% | 2,51% | -2,77% |
| Volatilidad / Riesgo: | 4,70% | 4,55% | 3,49% | 3,73% | 3,40% | 3,27% | 2,45% | 2,34% | 2,48% |

Rentabilidades mensuales

| | Enero | Feb. | Marzo | Abril | Mayo | Junio | Julio | Agosto | Sept. | Oct. | Nov. | Dic. | Año |
|------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2018 | +1,11% | -1,21% | -0,36% | -0,99% | -1,33% | | | | | | | | -2,77% |
| 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% |

Rentabilidades mensuales anteriores a diciembre de 2014 calculadas según *backtesting*, bajo la hipótesis de haber aplicado el actual método de inversión de la cesta en el pasado.