

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
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities Class IE	3,78%
ETF Italy Government Bond 10 years	7,50%
ETF Treasury United States 30 years	9,48%
T. Rowe Price Funds SICAV - European Smaller Companies Equity Fund	3,78%
Candriam Bonds Emerging Debt Local Currencies Fund	2,50%
ETF UK Government Bond 10 years	5,68%
PIMCO GIS Emerging Local Bond Fund E Class EUR	2,50%
ETF Stoxx 600 Europe Index	0,82%
ETF S&P 500 Index	0,25%
ETF German Bund 30 years	2,89%
ETF Eonia Capitalization Monetario	19,49%
ETF Nikkei 225	11,00%



Evolución histórica del valor liquidativo (10,349321 a 30-11-2019)



	Año 2011	Año 2012	Año 2013	Año 2014	Año 2015	Año 2016	Año 2017	Año 2018	Año 2019
Rentabilidad:	1,64%	5,33%	5,30%	2,67%	3,16%	1,97%	2,51%	-4,69%	5,51%
Volatilidad / Riesgo:	4,55%	3,49%	3,73%	3,40%	3,27%	2,45%	2,34%	2,11%	2,07%

Rentabilidades mensuales

	Enero	Feb.	Marzo	Abril	Mayo	Junio	Julio	Agosto	Sept.	Oct.	Nov.	Dic.	Año
2019	+1,41%	-0,23%	+1,27%	+0,45%	-0,43%	+1,47%	+0,73%	+1,10%	-0,87%	-0,24%	+0,75%		+5,51%
2018	+1,11%	-1,21%	-0,36%	-0,99%	-1,33%	-0,44%	-0,11%	+0,57%	-0,53%	-1,46%	+0,06%	-0,08%	-4,69%
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%	+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%