

Cesta Sigma Multiactivos

Indicador resumido del riesgo global:



Indicador de riesgo de mercado:



Filosofía de inversión

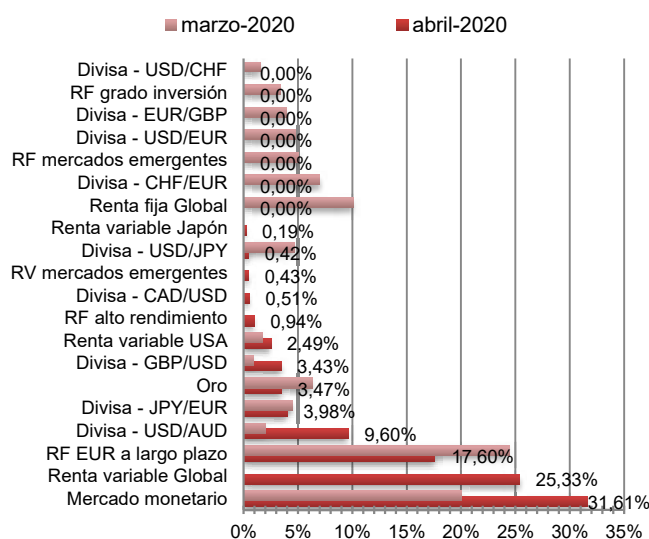
Modalidad de inversión incluida en el Plan de Ahorro Multinversión, que permite participar a través del fondo *DIP Conservative Multi Asset*, en una cesta de fondos de inversión que invierte en un amplio abanico de activos financieros (renta fija, renta variable, materias primas, divisas, inflación, 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
Fut. Treasury United States 2 years "Note"	17,12%
Fut. Treasury United States 5 years "Note"	8,21%
Fut. Treasury United States 10 years "Note"	17,61%
Fut. Nikkei 225 Index	0,19%
Robeco High Yield Bond	0,94%
WisdomTree Physical Gold (EUR)	3,47%
Schroder International Emerging Markets	0,43%
Fut. Long GBP/USD	3,43%
Fut. Long CAD/USD	0,51%
Fut. Short USD/AUD	9,60%
Fut. Nasdaq 100 Stock Index	2,49%
ETF Eonia Capitalization Monetario	31,61%
Fut. Short JPY/EUR	3,98%



Evolución histórica del valor liquidativo (10,046249 a 30-04-2020)



	Año 2012	Año 2013	Año 2014	Año 2015	Año 2016	Año 2017	Año 2018	Año 2019	Año 2020
Rentabilidad:	5,33%	5,30%	2,67%	3,16%	1,97%	2,51%	-4,69%	5,44%	-2,87%
Volatilidad / Riesgo:	3,49%	3,73%	3,40%	3,27%	2,45%	2,34%	2,11%	2,21%	3,42%

Rentabilidades mensuales

	Enero	Feb.	Marzo	Abril	Mayo	Junio	Julio	Agosto	Sept.	Oct.	Nov.	Dic.	Año
2020	-0,58%	+0,14%	-3,08%	+0,66%									-2,87%
2019	+1,41%	-0,23%	+1,27%	+0,45%	-0,43%	+1,47%	+0,73%	+1,10%	-0,87%	-0,24%	+0,75%	-0,06%	+5,44%
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%	-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%