

## Cesta Sigma Multiactivos

Indicador resumido del riesgo global:



Indicador de riesgo de mercado:



### Filosofía de inversión

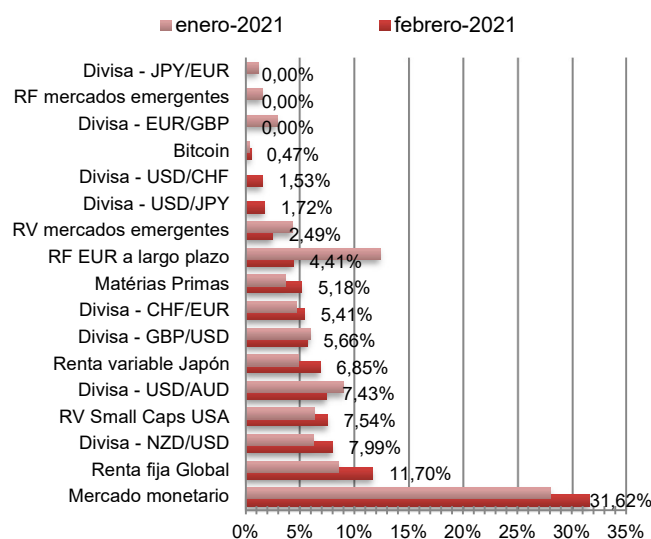
Modalidad de inversión incluida en el Plan de Ahorro Multinversión, que permite participar a través del fondo *DIP Conservative Multi Asset*, en una cesta de fondos de inversión que invierte en un amplio abanico de activos financieros (renta fija, renta variable, materias primas, divisas, inflación, 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. Italy BTP 10 years                 | 4,41%                   |
| Bitcoin Tracker one Eur                 | 0,47%                   |
| Fut. Russell 2000 Stock Index           | 7,54%                   |
| Fut. US Note years                      | 7,50%                   |
| Threadneedle LUX-Enh Comm IU (EUR)      | 5,18%                   |
| Fut. Germany BOBL 5 years               | 4,20%                   |
| Fut. Long NZD/USD                       | 7,99%                   |
| Fut. Short CHF/EUR                      | 5,41%                   |
| Schroder International Emerging Markets | 2,49%                   |
| Fut. Short USD/AUD                      | 7,43%                   |
| Fut. Nikkei 225 Stock Index             | 6,85%                   |
| ETF Eonia Capitalization Monetario      | 31,62%                  |
| Fut. Long GBP/USD                       | 5,66%                   |



### Evolución histórica del valor liquidativo (10,417777 a 28-02-2021)



|                       | Año 2013 | Año 2014 | Año 2015 | Año 2016 | Año 2017 | Año 2018 | Año 2019 | Año 2020 | Año 2021 |
|-----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Rentabilidad:         | 5,30%    | 2,67%    | 3,16%    | 1,97%    | 2,51%    | -4,69%   | 5,44%    | -0,07%   | 0,79%    |
| Volatilidad / Riesgo: | 3,73%    | 3,40%    | 3,27%    | 2,45%    | 2,34%    | 2,11%    | 2,21%    | 3,16%    | 3,01%    |

### Rentabilidades mensuales

|      | Enero  | Feb.   | Marzo  | Abril  | Mayo   | Junio  | Julio  | Agosto | Sept.  | Oct.   | Nov.   | Dic.   | Año    |
|------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2021 | +0,36% | +0,43% |        |        |        |        |        |        |        |        |        |        | +0,79% |
| 2020 | -0,58% | +0,14% | -3,08% | +0,66% | +0,11% | -0,13% | +0,30% | +0,10% | -0,40% | +0,58% | +1,46% | +0,83% | -0,07% |
| 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% |