la mutua de los ingenieros

PLAN DE AHORRO MULTINVERSIÓN

Cesta Sigma Multiactivos

Indicador resumido del riesgo global: 1 **2** 3 4 5 6 7 (Riesgo más bajo ➲ ➲ Riesgo más alto)

Indicador de riesgo de mercado: ✪✪✪✩✩

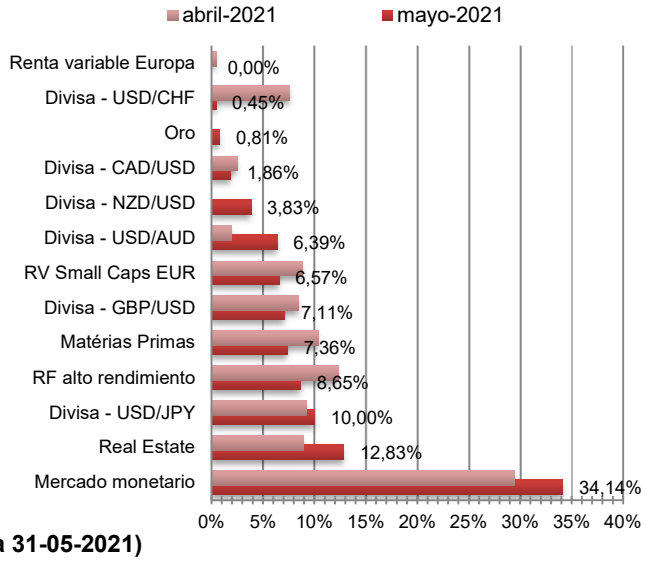
Filosofía de inversión

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
Candriam GF US High Yield - IEURU	4,59%
Threadneedle LUX-Enh Comm IU (EUR)	7,36%
Neuberg Berm US RL Esta-EADV	12,83%
DWS Invest-EU Small Cap-TFC	4,16%
Threadneedle-Pan EU Small Caps O-IE	2,41%
Threadneedle US-High Yield B-ZUE	4,06%
ETF Eonia Capitalization Monetario	34,14%
BGF-World Gold-E2 Eur	0,81%
Fut. Long NZD/USD	3,83%
Fut. Short USD/CHF	0,45%
Fut. Short USD/JPY	10,00%
Fut. Long CAD/USD	1,86%
Fut. Short USD/AUD	6,39%
Fut. Long GBP/USD	7,11%



Evolución histórica del valor liquidativo (10,585171 a 31-05-2021)

	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%	2,41%
Volatilidad / Riesgo:	3,73%	3,40%	3,27%	2,45%	2,34%	2,11%	2,21%	3,16%	2,01%

Rentabilidades mensuales

	Enero	Feb.	Marzo	Abril	Mayo	Junio	Julio	Agosto	Sept.	Oct.	Nov.	Dic.	Año
2021	+0,36%	+0,43%	+0,24%	+0,80%	+0,56%								**+2,41%**
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%**

https://www.mutua-enginyers.com/es/particulars/estalvi_i_pensions/plans_d_estalvi/pla_d_estalvi_multinversio