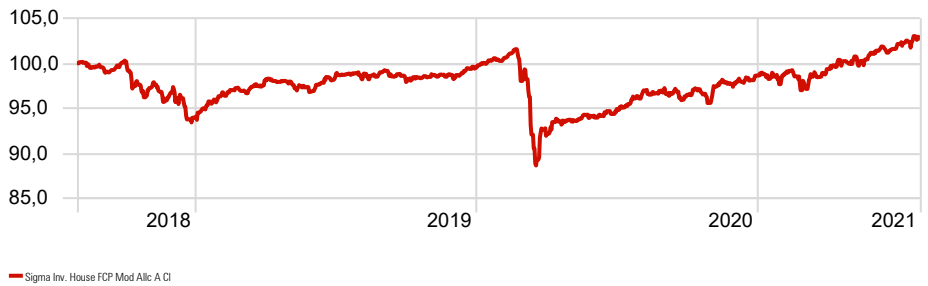


Datos fundamentales

Fecha de la Cartera	31/07/2021
Nombre	Sigma Inv. House FCP Mod Alloc A CI
ISIN	LU0986191350
Domicilio	Luxemburgo
Estructura Legal	FCP
Entidad gestora	Andbank Asset Management Luxembourg
Patrimonio	15.153.824
Divisa	Euro
NAV	104,70
Management Fee	0,63%
Distribution Fee	0,77%

Evolución del fondo vs Benchmark

Time Period: 01/08/2018 to 31/07/2021



Objetivo de Inversión

El subfondo tiene como objetivo lograr un rendimiento superior al Euribor 3 meses + 150 pbs con una volatilidad en torno al 6% a través de la inversión en OICVM y OIC, y Exchange Traded Funds elegibles (ETFs). Dichos OICVM y OIC tendrán exposición a una variedad de clases de activos que incluyen, entre otros, títulos de renta variable, emisiones de deuda, materias primas, fondos de inversión inmobiliaria y estrategias de inversión alternativas.

El gestor aplicará una metodología de inversión sobre un universo global de activos para obtener una cartera multi-activo con un nivel de riesgo moderado y un horizonte de inversión entre 3 y 5 años. La metodología se basa en tres pilares básicos: la diversificación, el retorno estable a largo plazo y el control de riesgo.

Clases por Inversor	ISIN	Divisa
A ord	LU0986191350	Euro
B Inst	LU0986192085	Euro
P Pension Fund	LU1171800854	Euro

Retornos Mensuales

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Año
2021	-1,0	-0,7	1,9	1,1	1,1	0,6	1,1						4,2
2020	0,8	-2,2	-5,4	1,0	0,4	0,6	1,5	0,7	-0,4	-0,7	1,9	1,3	-0,9
2019	2,5	0,7	0,6	0,4	-1,1	1,3	0,7	0,1	-0,4	-0,1	0,2	0,8	5,8
2018	0,5	-1,3	-1,1	0,5	-0,7	-1,4	0,1	-0,5	0,5	-3,0	-0,3	-2,9	-9,1

*Rentabilidades pasadas no son garantía de rentabilidades a futuro

Posiciones

Portfolio Date: 31/07/2021

	Peso %	Divisa
iShares US Mortg Backed Secs ETF USD Dis	11,6	US Dollar
Amundi IS Gvt Bd Lwst Rtd Er InvGr ETF-D	10,5	Euro
SPDR® Bimbrg Bcly 1-3 Yr EUR Govt BdETF	8,6	Euro
Amundi Physical Gold ETC C	6,7	US Dollar
iShares € Corp Bond BBB-BB ETF EUR Dist	4,7	Euro
OssiamESGLwCrbnShlrBclyCAPE@USSecETF1A\$	4,6	US Dollar
iShares Global Corp Bond EURH ETF Dist	4,6	Euro
iShares Global Infl Lnkd GovBd ETF \$ Acc	3,5	US Dollar
Amundi IS MSCI Emerging Markets ETF-C €	3,1	Euro
iShares Nikkei 225® ETF (DE)	3,1	Japanese Yen

Retorno por Periodos

	Return
1 mes	1,1
3 meses	2,8
6 meses	5,2
YTD	4,2
12 meses	6,9
Desde Inicio	4,3

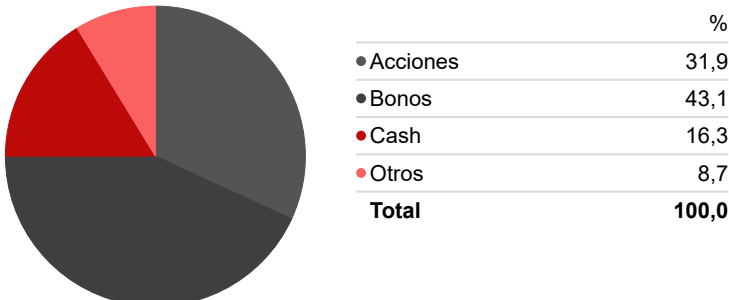
Ratios de Riesgo

Time Period: 01/08/2018 to 31/07/2021

	Inv	Bmk1
Std Dev	5,3	9,4
Max Drawdown	-7,5	-12,9
Beta	0,5	1,0
Sharpe Ratio (arith)	0,3	0,5
Tracking Error	5,2	0,0

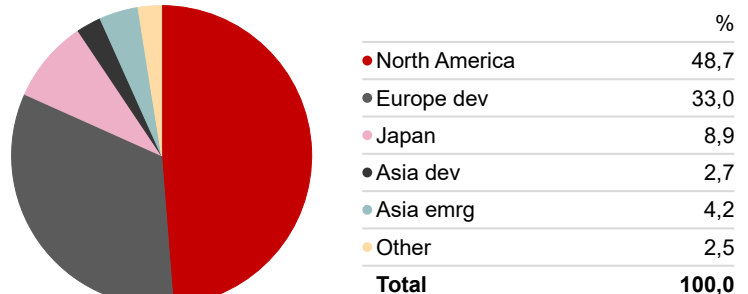
Distribución por Activos*

Portfolio Date: 31/07/2021



Distribución Geográfica*

Portfolio Date: 31/07/2021



*La distribución de activos y la distribución geográfica de la renta variable se ha calculado usando los datos de cada uno de los activos del fondo.