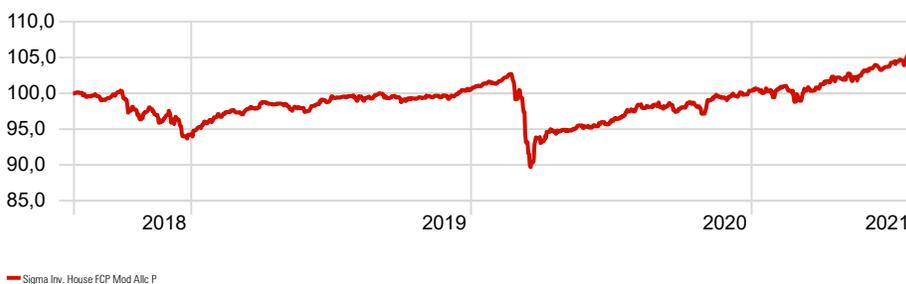


Datos fundamentales

Fecha de la Cartera	31/07/2021
Nombre	Sigma Inv. House FCP Mod Allc P
ISIN	LU1171800854
Domicilio	Luxemburgo
Estructura Legal	FCP
Entidad gestora	Andbank Asset Management Luxembourg
Patrimonio	15.153.824
Divisa	Euro
NAV	103,18
Management Fee	0,32%
Distribution Fee	0,39%

Evolución del fondo vs Benchmark

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



Objetivo de Inversión

El subfondo persigue una rentabilidad superior a la de los instrumentos de liquidez con una baja volatilidad. El subfondo invertirá principalmente en participaciones de OICVM, OIC y ETF elegibles, incluidos los gestionados o distribuidos por empresas de Andbank Group y otros subfondos del fondo. Los OICVM y OIC estarán expuestos a una serie de clases de activos que incluyen, sin carácter limitativo, títulos de renta variable, títulos de deuda, obligaciones convertibles, divisas e instrumentos del mercado monetario; algunos de ellos buscarán estrategias de inversión alternativas o invertirán en instrumentos derivados financieros. El subfondo puede invertir directamente en acciones y títulos de deuda. El subfondo también podrá utilizar todo tipo de instrumentos financieros derivados con fines de cobertura y para gestionar eficazmente su cartera (exposición máxima: 100%).

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

Retornos Mensuales

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

*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	1,2
3 meses	3,0
6 meses	5,5
YTD	4,6
12 meses	7,7
Desde Inicio	2,8

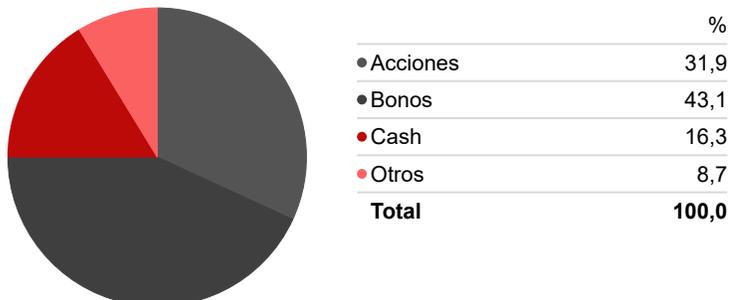
Ratios de Riesgo

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

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

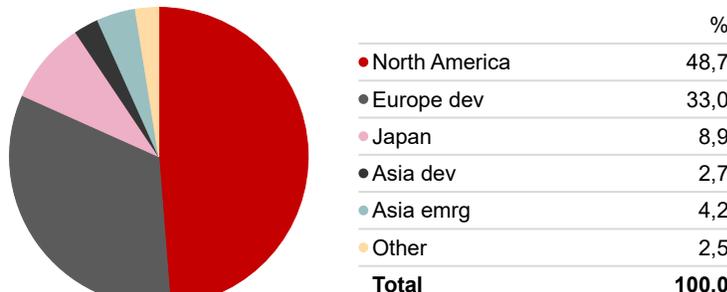
Distribución por Activos*

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.