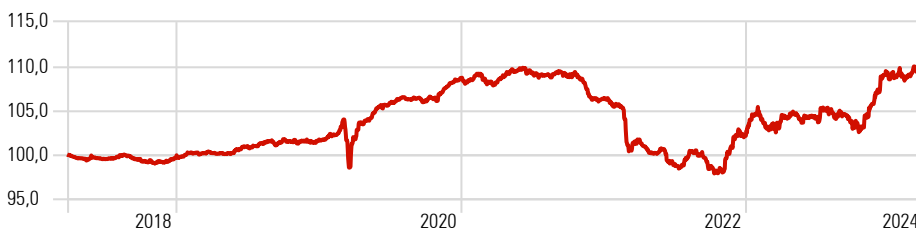


Datos fundamentales

Fecha de la Cartera	31/03/2024
Nombre	Sigma Flexible Fixed Income USD
ISIN	LU1697013008
Domicilio	Luxemburgo
Estructura Legal	FCP
Entidad gestora	Andbank Asset Management Luxembourg
Patrimonio	\$ 34.182.420
Divisa	US Dollar
NAV	\$ 109,55
Duración modificada	
Rendimiento al vencimien	

Evolución del fondo vs Benchmark

Time Period: Since Common Inception (29/03/2018) to 31/03/2024



— Sigma Flexible Fixed Income USD

Objetivo de Inversión

Fondo de Renta Fija Global. Se caracteriza por una gestión activa, flexible y dinámica de los tipos de interés y de crédito. Es un fondo denominado en USD, con una duración media de la cartera entre -2,5 y 7 años, una exposición máxima a otras divisas del 30% y una calidad crediticia media de la cartera de grado de inversión.

Retorno por Periodos

Periodo	Return
1 mes	1,1
3 meses	0,7
6 meses	6,1
YTD	0,7
12 meses	6,1
Desde Inicio	10,1

Ratios de Riesgo

Time Period: Since Common Inception (29/03/2018) to 31/03/2024

Ratio	Value
Alpha	3,2
Beta	0,0
Volatilidad (Std Dev)	3,2
Downside Deviation	5,8
R2	0,0
Sharpe Ratio (arith)	1,5
Return	1,6
Tracking Error	10,1

Rentabilidades mensuales

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Año
2024	0,3	-0,6	1,1										0,7
2023	2,5	-1,5	0,6	0,9	-0,5	0,1	1,0	-0,3	-1,1	-0,7	3,4	2,6	7,0
2022	-0,8	-2,5	-1,2	-1,4	0,5	-1,8	0,6	0,7	-1,7	-0,1	3,1	0,9	-3,9
2021	-0,2	0,0	-0,3	1,0	0,4	-0,3	-0,3	0,2	-0,3	-0,1	-2,1	-0,1	-2,1
2020	0,8	0,8	-1,2	1,8	1,3	0,4	0,7	-0,1	-0,3	0,1	1,6	0,8	7,1
2019	0,6	-0,2	0,2	-0,1	0,2	0,5	0,1	0,5	-0,1	0,2	-0,2	0,0	1,9
2018				-0,4	0,1	-0,2	0,1	0,2	-0,4	-0,3	-0,1	0,5	

*Rentabilidades pasadas no son garantía de rentabilidades a futuro

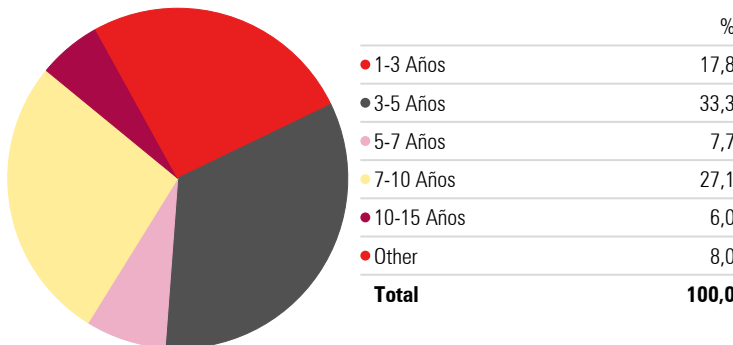
Principales posiciones

Portfolio Date: 31/03/2024

Posición	Peso %
Intesa Sanpaolo S.p.A. 8.248%	1,7
Yara International ASA 7.378%	1,7
Intesa Sanpaolo S.p.A. 7.2%	1,6
HSBC Holdings PLC 7.39%	1,6
ArcelorMittal S.A. 6.8%	1,6
Enel Finance America LLC 7.1%	1,6
PNC Financial Services Group Inc. 6.037%	1,6
Elevance Health Inc. 5.5%	1,6
UBS Group AG 6.327%	1,5
Volkswagen Group of America Finance LLC 5.65%	1,5

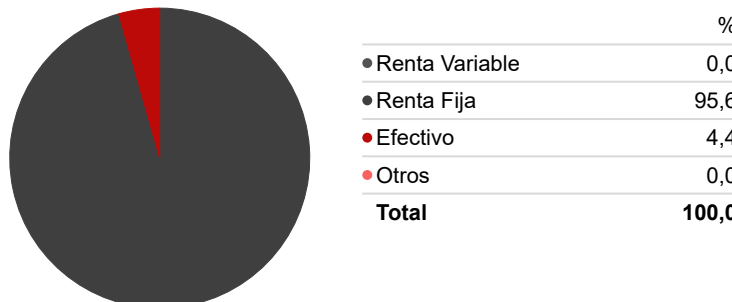
Distribucion por duración*

Portfolio Date: 31/03/2024



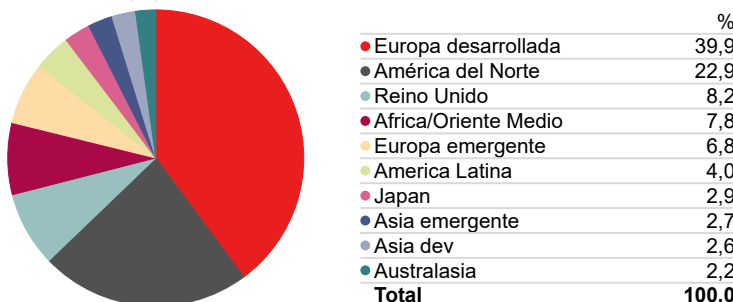
Distribución tipo de activo*

Portfolio Date: 31/03/2024



Distribución geográfica de la Renta Fija*

Portfolio Date: 31/03/2024



*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.