

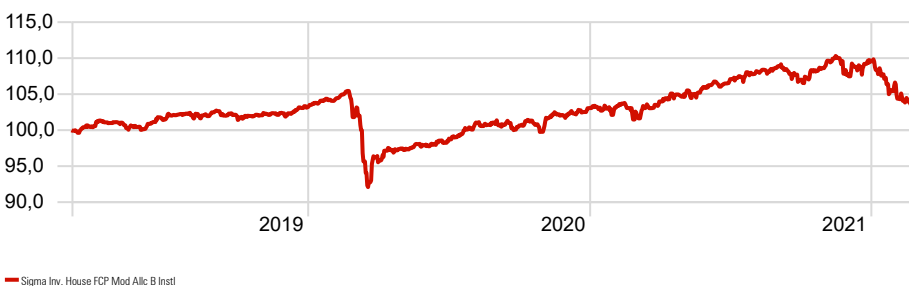
Sigma Inv.House FCP Moderate Allocation -B

Datos fundamentales

Fecha de la Cartera	31/01/2022
Nombre	Sigma Inv. House FCP Mod Allc B Instl
ISIN	LU0986192085
Domicilio	Luxemburgo
Estructura Legal	FCP
Entidad gestora	Andbank Asset Management Luxembourg
Patrimonio	6.229.109
Divisa	Euro
NAV	97,55
Management Fee	0,32%
Distribution Fee	0,39%

Evolución del fondo vs Benchmark

Time Period: 01/03/2019 to 28/02/2022



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
B Inst	LU0986192085	Euro
A ord	LU0986191350	Euro
P Pension Fund	LU1171800854	Euro

Retornos Mensuales

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

*Rentabilidades pasadas no son garantía de rentabilidades a futuro

Posiciones

Portfolio Date: 31/01/2022

	Peso %	Divisa
iShares US Mortg Backed Secs ETF USD Dis	9,1	US Dollar
iShares Dev Mkts Prpty Yld ETF USD Dist	8,6	US Dollar
SPDR® Bimbrg Bcly 1-3 Yr EUR Govt BdETF	6,8	Euro
Amundi Physical Gold ETC C	6,8	US Dollar
Amundi IS Gvt Bd Lwst Rtd Er InvGr ETF-D	5,4	Euro
iShares € Corp Bond BBB-BB ETF EUR Dist	4,4	Euro
OssiamESGLwCrbnShlrBclyCAPE@USSecETF1A\$	4,3	US Dollar
iShares Global Corp Bond EURH ETF Dist	4,2	Euro
iShares Global Infl Lnkd GovBd ETF \$ Acc	3,4	US Dollar
WisdomTree Enhanced Cmdty ETF USD Acc	3,4	US Dollar

Retorno por Periodos

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

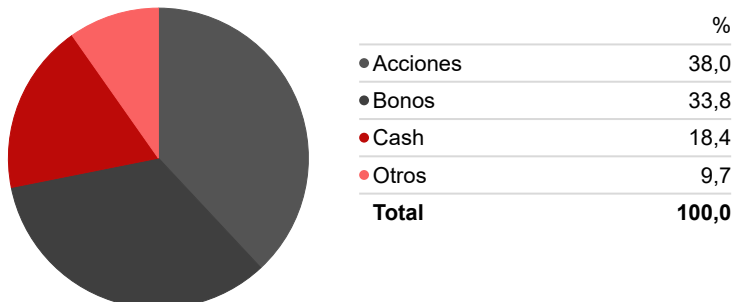
Ratios de Riesgo

Time Period: 01/03/2019 to 28/02/2022

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

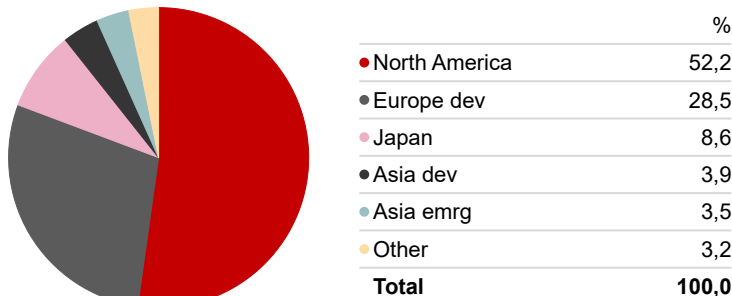
Distribución por Activos*

Portfolio Date: 31/01/2022



Distribución Geográfica*

Portfolio Date: 31/01/2022



*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.