

Datos fundamentales

| | |
|---------------------|-------------------------------------|
| Fecha de la Cartera | 29/02/2020 |
| Nombre | Sigma Inv. House FCP Mod Allc A Ci |
| ISIN | LU0986191350 |
| Domicilio | Luxembourg |
| Estructura Legal | FCP |
| Entidad gestora | Andbank Asset Management Luxembourg |
| Patrimonio | 18 638 848 |
| Divisa | Euro |
| NAV | 98,42 |
| Management Fee | 1,40% |
| Distribution Fee | 1,00% |

Evolución del fondo vs Benchmark

Time Period: 01/03/2017 to 29/02/2020



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 |
|------|-----|------|------|-----|------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| 2020 | 0,8 | -2,2 | | | | | | | | | | | -1,5 |
| 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 |
| 2017 | 0,6 | 1,1 | -0,2 | 0,3 | -0,5 | -0,7 | -0,4 | 0,2 | 0,5 | 0,5 | -0,7 | 0,5 | 1,2 |

*Rentabilidades pasadas no son garantía de rentabilidades a futuro

Posiciones

Portfolio Date: 29/02/2020

| | Peso % | Divisa |
|------------------------------------------|--------|-----------|
| iShares US Mortg Backed Secs ETF USD Dis | 12,1 | US Dollar |
| Amundi IS Gvt Bd Lwst Rtd Er InvGr ETF-D | 11,0 | Euro |
| WisdomTree Physical Gold | 9,1 | US Dollar |
| SPDR® Blmrg Bcly 1-3 Yr EUR Govt BdETF | 8,7 | Euro |
| Ossiam Shiller BclyCp®US SectValTR 1C\$ | 6,2 | US Dollar |
| iShares Global Corp Bond EURH ETF Dist | 4,8 | Euro |
| iShares € Corp Bond BBB-BB ETF EUR Dist | 4,7 | Euro |
| iShares € High Yield CorpBd ETF EUR Dist | 4,7 | Euro |
| Principality of Andorra 1.75% | 4,2 | |
| Amundi Physical Gold ETC C | 4,0 | US Dollar |

Retorno por Periodos

| | Return |
|--------------|--------|
| 1 mes | -2,2 |
| 3 meses | -0,7 |
| 6 meses | -1,0 |
| YTD | -1,5 |
| 12 meses | 1,1 |
| Desde Inicio | -0,5 |

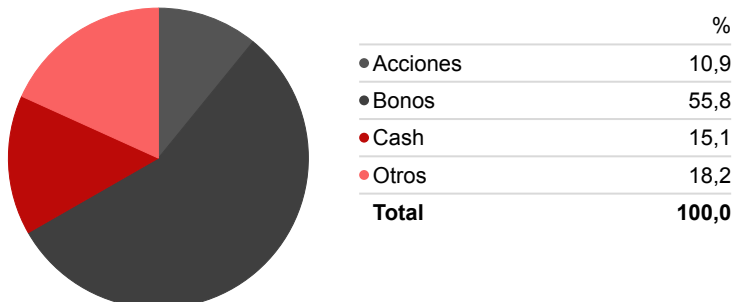
Ratios de Riesgo

Time Period: 01/03/2017 to 29/02/2020

| | Inv | Bmk1 |
|----------------------|------|------|
| Std Dev | 3,8 | 5,9 |
| Max Drawdown | -9,6 | -9,8 |
| Beta | 0,6 | 1,0 |
| Sharpe Ratio (arith) | -0,4 | 0,1 |
| Tracking Error | 2,9 | 0,0 |

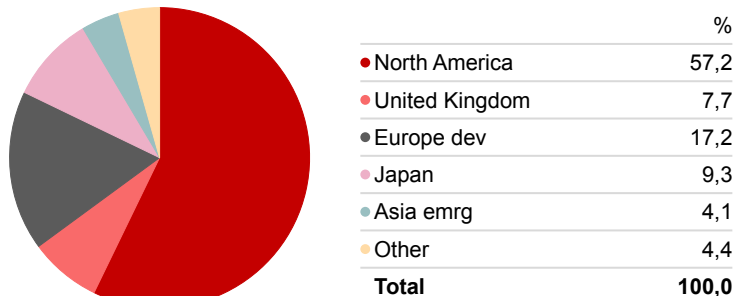
Distribución por Activos*

Portfolio Date: 29/02/2020



Distribución Geográfica*

Portfolio Date: 29/02/2020



*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.