

Sigma Inv.House FCP Balanced - P

Risk Level 1 | 2 | 3 **4** | 5 | 6 | 7

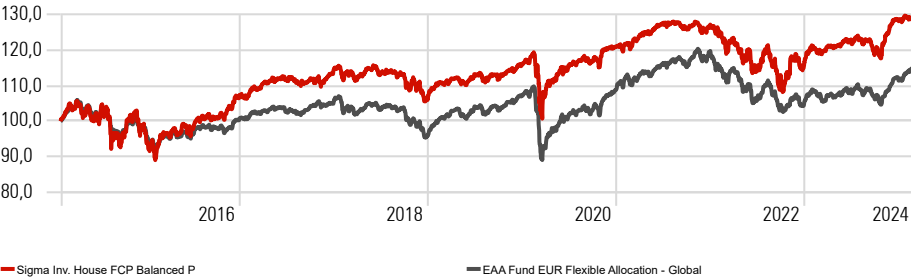
ANDBANK
asset management

Key Figures

Portfolio Date	29/02/2024
Name	Sigma Inv. House FCP Balanced P
ISIN	LU1171801233
Domicile	Luxembourg
Fund Legal Structure	FCP
Firm Name	Andorra Gestió Agrícola Reig SAU
Fund Size	138.243.794
Base Currency	Euro
NAV	129,89

Investment Growth vs Benchmark

Time Period: Since Common Inception (10/02/2015) to 29/02/2024



Investment Objective

The objective is to provide both long term capital growth and income. The sub-fund will hold between 30% and 80% of its assets in equity securities. The sub-fund will invest between 30% and 80% of its assets in debt securities. The sub-fund may also invest up to 10% of its assets in units of UCITS and UCIs. The sub-fund may also use all types of financial derivative instruments for hedging and efficient portfolio management (maximum exposure: 100%).

Returns per Period

	Return
1 Month	-0,3
3 Months	2,5
6 Months	4,9
YTD	0,1
12 Months	8,2
Since Inception	29,0

Risk Ratios

	Time Period: Since Common Inception (10/02/2015) to 29/02/2024	Inv Bmk1
Alpha	1,2	0,0
Beta	1,2	1,0
Volatilidad (Std Dev)	9,9	5,1
Downside Deviation	3,6	0,0
R2	57,4	100,0
Sharpe Ratio (arith)	0,4	0,3
Tracking Error	6,6	0,0

Monthly Returns

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Año
2024	0,5	-0,3											0,1
2023	4,8	-1,0	1,4	0,3	0,4	0,9	1,1	-1,0	-2,2	-1,2	5,9	2,3	12,0
2022	-0,2	-2,3	-0,7	-2,3	0,3	-5,0	4,9	-3,0	-6,1	4,4	4,6	-3,3	-9,1
2021	-1,1	0,5	2,5	1,3	0,7	1,2	0,1	0,4	-1,4	0,8	-1,5	1,0	4,5
2020	0,7	-3,2	-4,0	3,0	2,4	0,5	0,9	1,5	-0,6	-1,3	4,3	0,7	4,7
2019	3,1	0,8	0,6	1,0	-1,9	1,8	0,5	-0,2	0,6	0,1	1,3	0,6	8,6
2018	1,0	-0,7	-1,7	1,2	1,1	-1,2	0,9	-0,3	-0,5	-2,4	0,2	-3,8	-6,2
2017	-0,2	2,7	1,1	0,7	0,4	0,0	0,1	-0,5	0,2	0,7	-0,4	1,4	6,4
2016	-2,9	0,2	1,6	0,8	2,1	-1,4	3,0	0,8	-0,7	0,8	2,3	2,4	9,3
2015			1,4	-1,7	1,1	-3,2	2,6	-6,1	-2,6	6,5	2,8	-5,3	
2014													
2013													
2012													

*Past performance does not guarantee futur results

Top Holdings

Portfolio Date: 29/02/2024

	Peso %	Divisa
United States Treasury Notes 4%	1,7	
Italy (Republic Of) 4%	1,6	
iShares JP Morgan \$ EM Bond ETF USD Dist	1,5	US Dollar
Germany (Federal Republic Of) 2.5%	1,4	
Germany (Federal Republic Of) 2.2%	1,4	
United States Treasury Notes 4.375%	1,3	
United States Treasury Notes 4%	1,3	
Barrick Gold Corp	1,2	Canadian Dollar
Visa Inc 4.15%	1,2	
Johnson & Johnson 3.625%	1,1	

Asset Allocation*

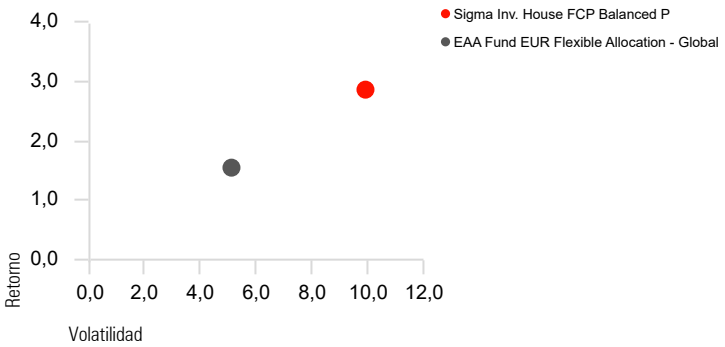
Portfolio Date: 29/02/2024



	%
Equity	45,0
Bonds	41,0
Cash	12,7
Others	1,3
Total	100,0

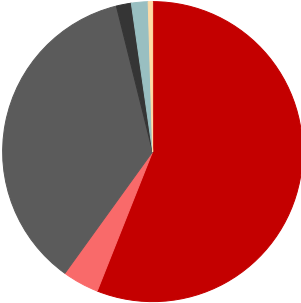
Risk-Return since Inception (Annualized)

Time Period: Since Common Inception (10/02/2015) to 29/02/2024



Equity Regional Exposure*

Portfolio Date: 29/02/2024



	%
North America	56,0
United Kingdom	3,9
Europe dev	36,2
Asia dev	1,6
Asia emrg	1,8
Other	0,5
Total	100,0

*The asset allocation and the equity regional exposure have been calculated taking into account the positioning of each of the funds

DISCLAIMER:
Este documento tiene carácter comercial y se suministra sólo con fines informativos. No constituye ni puede interpretarse como una oferta, invitación o incitación para la venta, compra o suscripción de valores ni su contenido constituirá base de ningún contrato, compromiso o decisión de cualquier tipo. Este documento no sustituye la información legal preceptiva, que deberá ser consultada con carácter previo a cualquier decisión de inversión; la información legal prevalece en caso de cualquier discrepancia. Se recomienda al inversor, que junto con este documento, lea la documentación relativa al organismo de inversión, que está a su disposición en la página www.andbank.com y en las oficinas de la entidad comercializadora. La información contenida en este documento se refiere a la fecha que aparece en el mismo, por lo que pudiera sufrir cambios como consecuencia de la fluctuación de los mercados. Las rentabilidades mostradas son rentabilidades pasadas y no presuponen rentabilidades futuras. La participación en organismos de inversión u otros productos financieros indicados en el presente documento pueden estar sujetos a riesgos de mercado, crédito, emisor y contrapartida, de liquidez y de cambio de moneda, fluctuaciones de valor y la posible pérdida del capital invertido.