

Sigma Inv.House FCP Flexible Fixed Income USD

ANDBANK
asset management

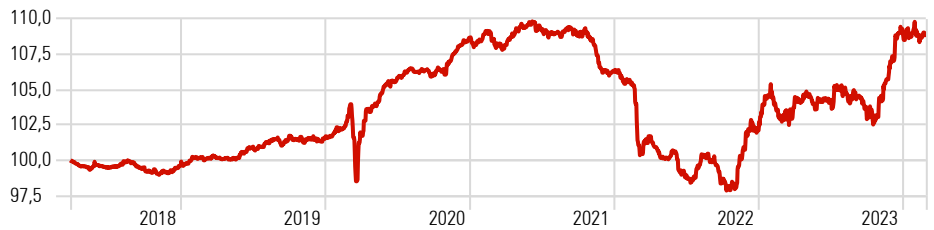
Risk Level 1 | 2 | 3 | **4** | 5 | 6 | 7

Key Figures

Portfolio Date	29/02/2024
Name	Sigma Flexible Fixed Income USD
ISIN	LU1697013008
Domicile	Luxembourg
Fund Legal Structure	FCP
Firm Name	Andbank Asset Management Luxembourg
Fund Size	\$ 33.694.284
Base Currency	US Dollar
NAV	\$ 109,80
Average Mod Duration	
Average YTM Survey	

Investment Growth vs Benchmark

Time Period: Since Common Inception (29/03/2018) to 29/02/2024



— Sigma Flexible Fixed Income USD

Investment Objective

Global Fixed Income Fund. It is characterized by an active, flexible and dynamic management of interest and credit rates. It is a USD denominated fund, with an average portfolio duration between -2.5 and 7 years, a maximum exposure to other currencies of 30% and an average portfolio rating of investment grade.

Returns per Period

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

Risk Ratios

Time Period: Since Common Inception (29/03/2018) to 29/02/2024

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

Monthly Returns

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Año
2024	0,3	-0,6											-0,3
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	

*Past performance does not guarantee futur results

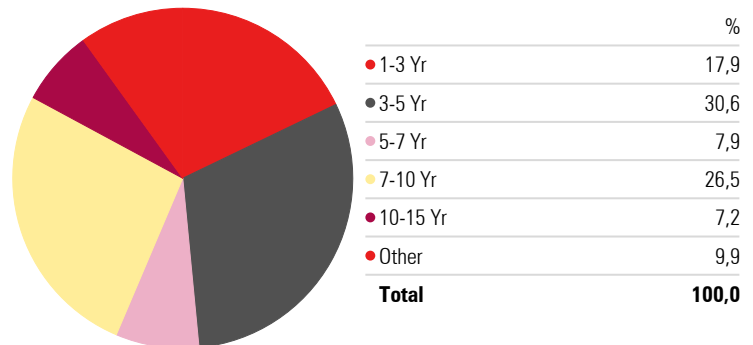
Top Holdings

Portfolio Date: 29/02/2024

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

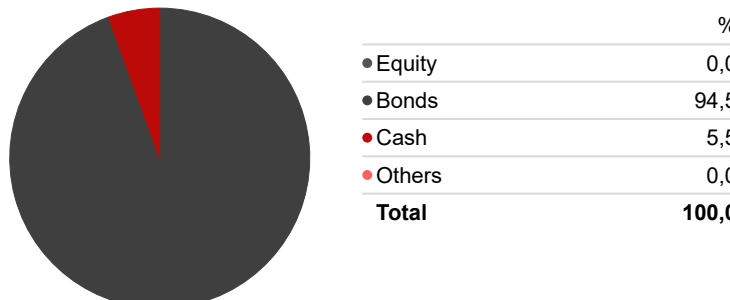
Distribution by Maturity*

Portfolio Date: 29/02/2024



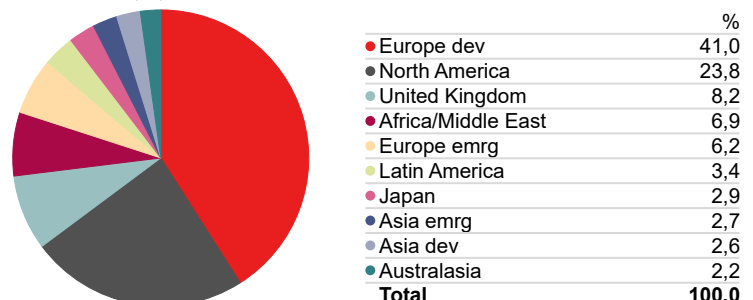
Asset Allocation*

Portfolio Date: 29/02/2024



Fixed Income Regional Exposure*

Portfolio Date: 29/02/2024



*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 entidades 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.