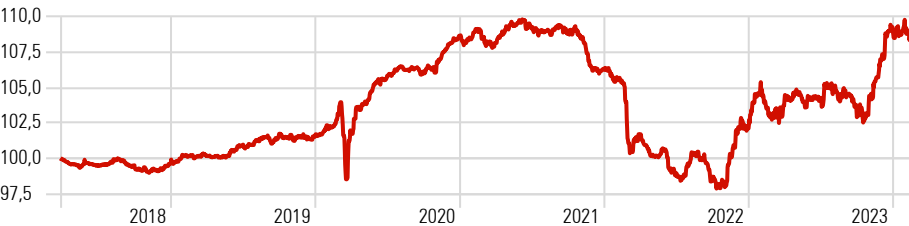


Datos fundamentales

Fecha de la Cartera	29/02/2024
Nombre	Sigma Flexible Fixed Income USD
ISIN	LU1697013008
Domicilio	Luxembourg
Estructura Legal	FCP
Entidad gestora	Andbank Asset Management Luxembourg
Patrimonio	\$ 33.694.284
Divisa	US Dollar
NAV	\$ 109,80
Duración modificada	
Rendimiento al vencimien	

Evolución del fondo vs Benchmark

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



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

	Return
1 mes	-0,6
3 meses	2,3
6 meses	3,8
YTD	-0,3
12 meses	5,6
Desde Inicio	9,0

Ratios de Riesgo

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

Rentabilidades mensuales

	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	

*Rentabilidades pasadas no son garantía de rentabilidades a futuro

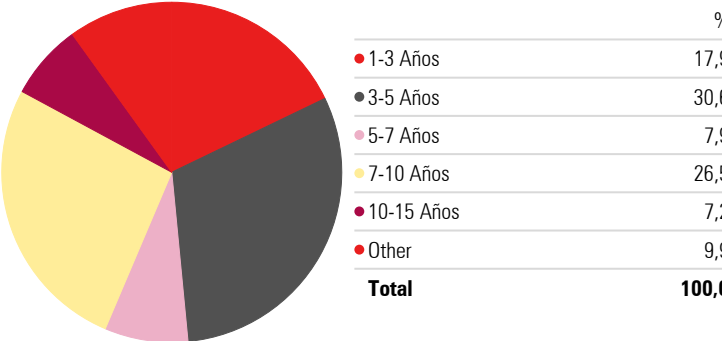
Principales posiciones

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

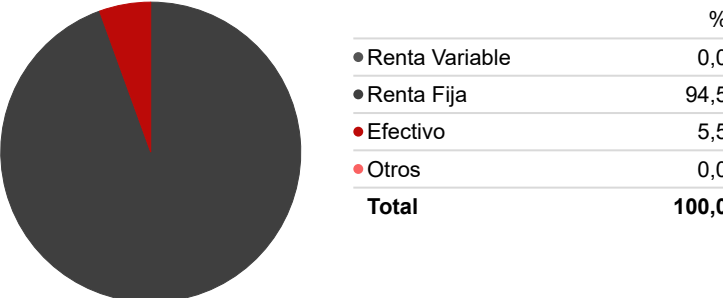
Distribucion por duración*

Portfolio Date: 29/02/2024



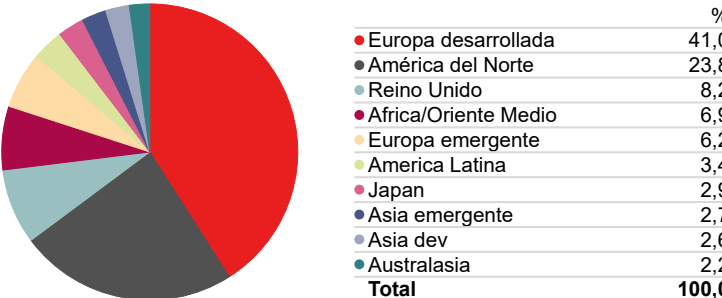
Distribución tipo de activo*

Portfolio Date: 29/02/2024



Distribución geográfica de la Renta Fija*

Portfolio Date: 29/02/2024



*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.

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.