

Sigma Fund Real Return

Global Multiestrategia



Informe Mensual 31 de agosto de 2021

Categoría I (EUR) NAV : 227,97 MTD : 2,13% YTD : 9,78% ISIN : LU0077114410 Bloomberg : SIGVALE LX

OBJETIVO Y DESCRIPCIÓN DEL FONDO

- ✓ Fondo Multiestrategia Global
- ✓ Objetivo: conservación del capital y rentabilidad absoluta anual independientemente de la evolución de los mercados.
- ✓ Categoría Morningstar : Alt - Multiestrategia
- ✓ Creado en junio de 2003
- ✓ Acceso a los mercados globales con menor volatilidad
- ✓ Valor liquidativo diario
- ✓ Experto equipo de asesores con más de 30 años de experiencia en gestión de inversiones
- ✓ Cotiza en la Bolsa de Luxemburgo. Denominado Sigma Fund Real Return desde julio de 2017

Análisis Técnico

Últimos 12 meses

Rentabilidad	18,08%
Volatilidad	8,30%
Sharpe Ratio	2,12

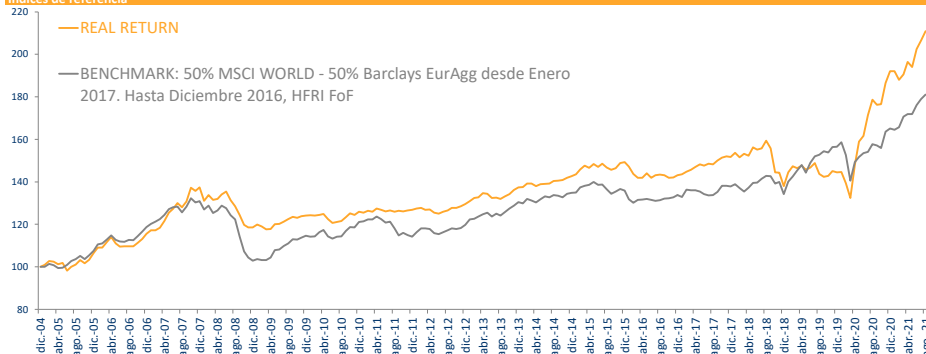
Últimos 5 años

Rentabilidad anualizada	8,02%
Volatilidad	10,05%
Sharpe Ratio	0,89

Desde inicio

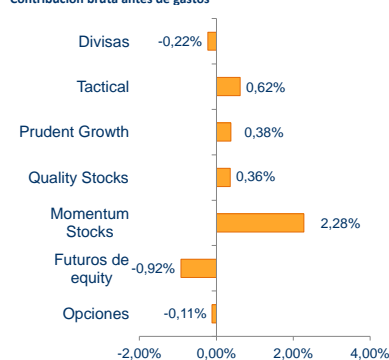
Rentabilidad acumulada	128,02%
Rentabilidad anualizada	4,62%
Volatilidad anualizada	6,64%
Meses positivos	67,28%

Índices de referencia

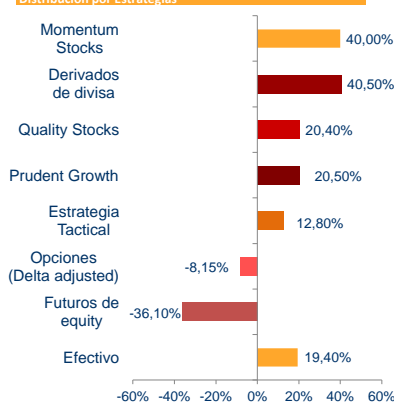


Contribución por Estrategias

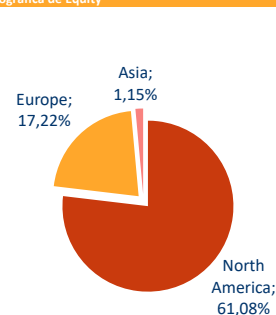
Contribución bruta antes de gastos



Distribución por Estrategias



Distribución Geográfica de Equity



RENDIMIENTO MENSUAL

Acciones Categoría "I" en Euros (Rent. Mensuales libres de comisiones)

	ene	feb	mar	abr	may	jun	jul	ago	sep	oct	nov	dic	Year
2021	0,02	-2,13	1,37	3,05	-1,23	4,39	1,95	2,13					9,78%
2020	0,16	-3,73	-4,93	11,68	7,41	1,77	6,08	4,15	-1,28	0,12	5,63	3,02	32,99%
2019	4,76	1,96	-0,63	0,81	-1,32	0,76	1,40	-3,42	-1,02	0,38	1,52	-0,38	4,70%
2018	1,34	-1,41	1,09	-0,61	2,65	-0,75	0,38	2,39	-2,34	-7,19	-0,11	-4,42	-9,03%
2017	0,36	0,81	0,68	0,89	0,88	-0,47	0,65	-0,26	1,24	0,92	0,45	-0,26	6,01%
2016	-1,33	-2,36	-3,64	0,06	1,43	-1,41	0,76	0,23	-0,15	-0,86	0,10	0,70	-4,13%
2015	0,63	1,51	1,32	-0,70	1,20	-0,92	0,98	-1,17	-0,73	0,47	1,67	0,28	4,57%
2014	0,13	1,14	0,02	-0,82	0,58	0,18	0,08	0,82	0,16	0,16	0,76	0,58	3,85%
2013	1,00	1,17	0,27	1,41	-0,23	-1,46	0,19	-0,54	1,00	0,80	1,44	0,86	6,03%
2012	0,46	0,25	-0,67	0,09	-1,21	-0,35	0,67	0,54	0,92	0,07	0,54	0,85	2,14%
2011	-0,35	0,66	-0,31	1,18	-0,44	-0,59	0,35	-0,54	0,42	-0,27	0,38	0,24	0,70%
2010	0,11	-0,13	0,28	0,37	-1,94	-1,52	0,35	0,45	1,42	1,47	-0,57	1,22	1,47%
2009	1,12	-0,71	-1,20	0,23	1,84	0,15	0,83	1,10	0,83	-0,36	0,56	0,29	4,74%
2008	-4,60	2,12	-1,76	0,42	1,58	0,97	-2,99	-2,14	-3,20	-3,78	-0,91	-0,06	-13,69%
2007	1,38	0,06	1,03	2,62	3,28	1,39	2,15	-1,55	2,14	4,98	-1,14	1,23	18,84%
2006	2,48	-0,03	2,36	2,13	-2,61	-1,37	0,12	-0,03	0,01	1,55	1,67	2,12	8,58%
2005	0,88	1,79	-0,19	0,69	-3,63	1,86	1,00	2,16	2,16	-1,45	1,54	3,07	6,44%
2004	1,19	0,83	0,62	0,10	-1,54	-0,35	0,03	-0,45	0,18	0,49	1,43	1,42	3,98%
2003						0,24	0,47	-0,79	1,11	1,26	0,40	1,23	3,97%

Información del Fondo

Divisa	EURO	Fecha de lanzamiento	Junio 2003
Riesgo del tipo de cambio	Variable (Cubierto dinámicamente)	Gestor	Altex Partners Gestión, S.G.I.I.C., S.A.U.
Suscripciones	Diarias	Domicilio social	Luxemburgo
Reembolsos	Diarias	Administrador	EFA European Fund Administration
Comisiones de reembolso	Ninguna	Depositorio	Quintet Private Bank Luxembourg
Comisión de gestión	Categoría "I": 0,60% anual + 10% performance fee Categoría "A": 1,10% anual + 10% performance fee Categoría "B": 1,90% anual sin performance fee	Auditor	KPMG
Patrimonio del Fondo	€50,9 M	Categoría "I"	ISIN Code LU0077114410 Telekurs 657034 Bloomberg SIGVALE LX
High Watermark (*)	Sí	Categoría "A"	LU0195489025 1889647 SIGVALB LX
		Categoría "B"	LU0337268725 3627151 SIGASDB LX

(*) High Watermark o Marca de Agua significa que no se cobra performance fee mientras que no se supere el mayor Valor Liquidativo históricamente alcanzado a final de año.

Nota legal

Cualquier inversión realizada en la mencionada Institución de Inversión Colectiva deberá materializarse en base a su prospectus correspondiente y no a la información aquí suministrada. Con este fin, el prospectus debidamente actualizado, está disponible previa petición.

La información contenida en este informe no debe ser considerada como publicidad que anime a invertir. Finalmente, se advierte que los resultados obtenidos y mencionados en esta información no constituyen por sí mismos garantía de resultados futuros, y que el valor de cualquier inversión puede fluctuar al alza o a la baja.



Para suscripciones contactar con:
Registrar Agent
European Fund Administration (EFA), Luxembourg
Tel: + 352 48 48 80 735 - Fax: + 352 48 65 61 80 02

Para más información contactar con:
Altex Partners Gestión
Tel: 34 91 3836130
Email: altex@altexpartners.com