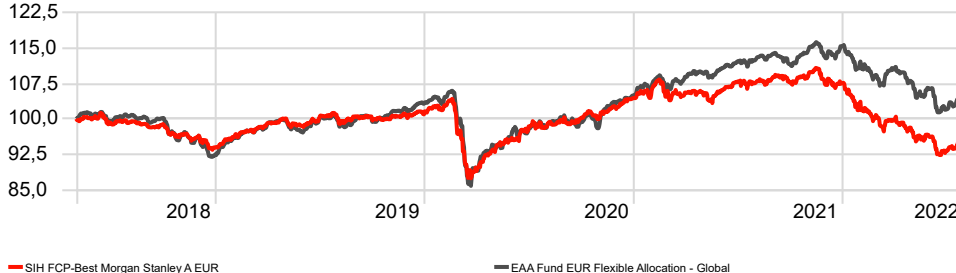


## Datos fundamentales

|                  |                                     |
|------------------|-------------------------------------|
| Fecha Cartera    | 31/07/2022                          |
| Nombre           | SIH FCP-Best Morgan Stanley A EUR   |
| ISIN             | LU1697018064                        |
| Domicilio        | Luxemburgo                          |
| Estructura Legal | FCP                                 |
| Entidad gestora  | Andbank Asset Management Luxembourg |
| Patrimonio       | 70.970.993                          |
| Divisa           | Euro                                |
| NAV              | 0,96                                |

## Evolución del Fondo vs Índice de referencia

Time Period: Since Common Inception (04/05/2018) to 31/07/2022



## Objetivo de inversión

SIGMA BEST es un esquema de inversión en el gestoras nacionales e internacionales aportan su análisis y estrategia para conseguir la mejor rentabilidad con una volatilidad controlada limitada al 10%.

El fondo invierte habitualmente un 75%-100% del patrimonio en IIC financieras que sean activo apto, armonizadas. Ninguna de estas IICs pertenecen al grupo de la gestora, con lo que se evita cualquier conflicto de intereses al estar invertido siempre en productos de terceros.

Puntualmente el porcentaje de inversión en IICs podrá ser menor, pero nunca inferior al 40%. Las IIC en que se invierte serán armonizadas en su práctica totalidad, y se tratará de IIC principalmente de Morgan Stanley IM, gestora de Reino Unido con elevado volumen de patrimonio gestionado y fondos comercializados.

Residualmente se podrá invertir (hasta un 10%) en IIC de otras gestoras. Morgan Stanley IM es el asesor de inversiones del fondo y por lo tanto define la estrategia de inversión de SIH Best Morgan Stanley.

## Rentabilidades acumuladas

|              | Retorno |
|--------------|---------|
| 1 mes        | 3,6     |
| 3 Meses      | -2,1    |
| 6 Meses      | -6,7    |
| YTD          | -10,6   |
| 12 Meses     | -10,6   |
| Desde Inicio | -3,9    |

## Ratios de riesgo

Time Period: Since Common Inception (04/05/2018) to 31/07/2022

|                       | Inv  | Bmk1  |
|-----------------------|------|-------|
| Alpha                 | -1,8 | 0,0   |
| Beta                  | 0,8  | 1,0   |
| Volatilidad (Std Dev) | 7,4  | 5,8   |
| Downside Deviation    | 3,1  | 0,0   |
| R2                    | 55,2 | 100,0 |
| Sharpe Ratio (arith)  | -0,1 | 0,4   |
| Tracking Error        | 5,2  | 0,0   |

## Rentabilidades mensuales

|      | Jan  | Feb  | Mar  | Apr  | May  | Jun  | Jul  | Aug  | Sep  | Oct  | Nov  | Dec  | Año   |
|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|-------|
| 2022 | -4,2 | -2,5 | -0,8 | -1,5 | -1,6 | -3,9 | 3,6  |      |      |      |      |      | -10,6 |
| 2021 | 0,0  | 0,3  | 0,4  | 0,6  | -0,1 | 2,2  | -0,2 | 0,9  | -0,5 | 0,6  | -0,3 | -0,7 | 3,0   |
| 2020 | 0,9  | -4,9 | -7,4 | 4,3  | 2,1  | 2,0  | 0,9  | 1,0  | 0,7  | 0,0  | 2,5  | 1,9  | 3,4   |
| 2019 | 2,3  | 1,2  | 1,3  | 1,4  | -1,4 | 0,9  | 1,3  | -0,2 | 0,0  | -0,6 | 1,0  | 0,1  | 7,4   |
| 2018 |      |      |      |      |      | -0,7 | -0,1 | -0,2 | -0,2 | -2,1 | -0,5 | -2,2 |       |

La rentabilidad registrada en el pasado no es ninguna garantía para el futuro

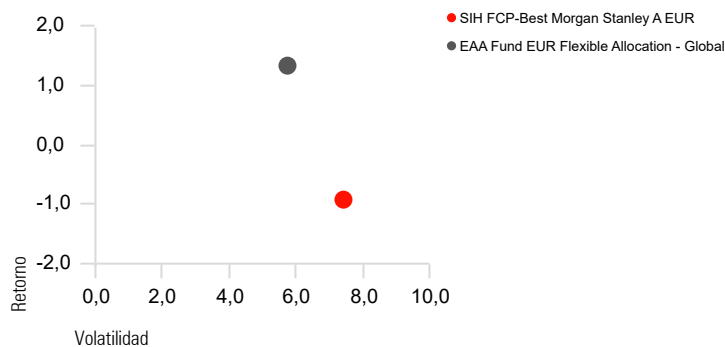
## Principales posiciones

Portfolio Date: 31/07/2022

|                                   | Peso % | Divisa       |
|-----------------------------------|--------|--------------|
| MS INV Short Maturity Euro Bond Z | 16,9   | Euro         |
| MS INV Global Bond ZH1 EUR        | 16,0   | Euro         |
| MS INV Euro Bond Z                | 6,1    | Euro         |
| MS INV Euro Corporate Bond Z      | 5,5    | Euro         |
| MS INV Japanese Equity Z          | 4,6    | Japanese Yen |
| MS INV US Dollar Corporate Bond Z | 3,9    | US Dollar    |
| MS INV Emerging Mkts Corp Debt Z  | 3,5    | US Dollar    |
| MS INV Global Fixed Income Opps Z | 3,5    | US Dollar    |
| iShares Core S&P 500 ETF USD Acc  | 3,0    | US Dollar    |
| MS INV Euro Strategic Bond Z      | 3,0    | Euro         |

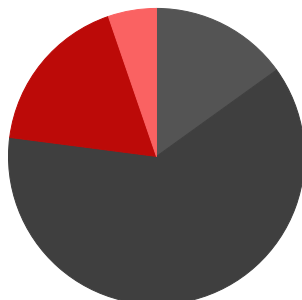
## Retorno-Riesgo desde lanzamiento (Anualizado)

Time Period: Since Common Inception (04/05/2018) to 31/07/2022



## Distribución de los activos\*

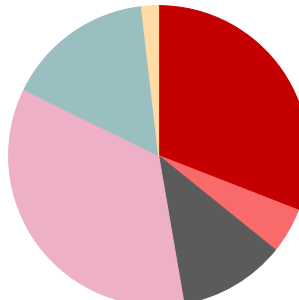
Portfolio Date: 31/07/2022



|              | %            |
|--------------|--------------|
| ● Acciones   | 15,1         |
| ● Bonos      | 62,0         |
| ● Liquidez   | 17,7         |
| ● Otros      | 5,3          |
| <b>Total</b> | <b>100,0</b> |

## Distribución geográfica de la Renta Variable\*

Portfolio Date: 31/07/2022



|                       | %            |
|-----------------------|--------------|
| ● América del Norte   | 30,9         |
| ● Reino Unido         | 4,9          |
| ● Europa desarrollada | 11,5         |
| ● Japón               | 35,0         |
| ● Asia emergente      | 15,9         |
| ● Other               | 1,8          |
| <b>Total</b>          | <b>100,0</b> |

\* Tanto la distribución de los activos como la distribución geográfica de la Renta Variable se ha calculado teniendo en cuenta el posicionamiento de cada uno de los fondos

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](http://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 entabilladas 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.