30/11/2021

MUTUAFONDO EQUILIBRIO FI "A" (EUR) ACC

Objetivo de inversión

Es un fondo de fondos que tiene como objetivo la consecución de retornos positivos en el largo plazo. La visión estratégica de Mutuactivos será la base para la construcción de la cartera. El fondo tendrá una volatilidad máxima anual inferior al 10%. Deberá invertir un mínimo del 50% del patrimonio en IIC financieras, que sean activo apto. La exposición a renta variable oscilará entre 20% y 50% de la exposición total del fondo. Información detallada en el DFI (Datos Fundamentales para el Inversor). ESTE FONDO PUEDE INVERTIR HASTA UN 80% EN EMISIONES DE RENTA FIJA DE BAJA CALIDAD CREDITICIA, POR LO QUE TIENE UN RIESGO DE CRÉDITO MUY ELEVADO.

Información general

ISIN
ES0175811001

Divisa
EUR

Inicio
02/07/2018

Nivel de riesgo
Bajo 1 2 3 **4** 5 6 7 Alto

Gestora
MUTUACTIVOS SGIIC (ES)

Subgestora
Mutuactivos SGIIC

Tipo de acción
Acumulación

Rango de gestión de renta variable
Mín. 25% — Máx. 50%

Inversión Mínima
Inicial 10 EUR
Adicional 0 EUR

UCITS
SI

Traspasable
SI

Último valor liquidativo
Valor liquidativo 105,65391 EUR
Fecha 30/11/2021

Índice de comparación
40% MSCI AC WORLD TOTAL RETURN (NDUEACWF) en euros, 40% BofAML 1-4 años Large cap index (EfmL) y 20% BofAML 5-7 años Large cap index (EML3).

AUM

Fecha	**13/12/2021**
Fondo	**24,58M**
Clase	**24,58M**

Comisiones

Gestión	**1,00%**
Depósito	**0,06%**
Gasto corriente	**1,55%**

Rentabilidad

02/07/2018 - 30/11/2021

	Fondo	Benchmark
YTD	**5,11%**	**8,48%**
1 mes	**-0,19%**	**0,14%**
3 meses	**0,19%**	**0,85%**
6 meses	**2,29%**	**4,37%**
1 año	**6,12%**	**8,48%**
3 años	**8,90%**	**8,48%**
5 años	**-**	**-**
10 años	**-**	**-**
Desde inicio	**6,88%**	**8,48%**

	2020	2019	2018*	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011
Fondo	-1,08%	7,62%	-4,49%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-	-	-	-	-

* Rentabilidad calculada desde 2/7/2018, fecha de inicio de inversión del fondo.

Medidas de riesgo

	Alfa	Beta	Volatilidad	Sharpe	Máx. Drawdown
Cartera	**0,010**	**0,73**	**4,91**	**0,68**	**-15,85**
Benchmark	**-**	**-**	**1,93**	**1,67**	**-1,75**

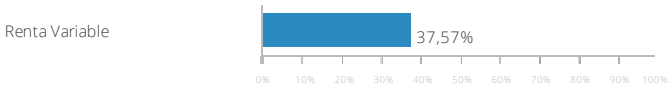
Datos calculados con la serie de rentabilidades diarios. Periodo de cálculo: desde inicio o máximo 3 años.

+34 900 555 559
info@mutuactivos.com
www.mutuactivos.com

30/11/2021

MUTUAFONDO EQUILIBRIO FI "A" (EUR) ACC

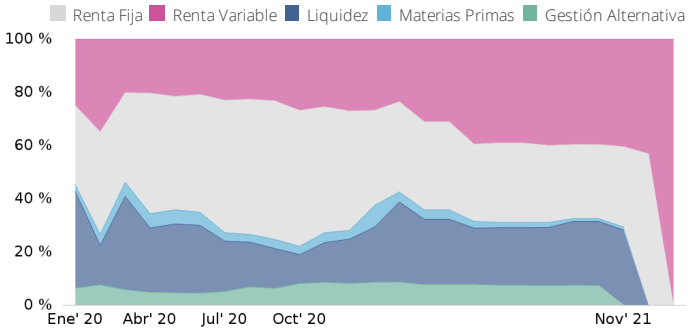
Tipo de activo



Sectores Renta Fija

Área geográfica Renta Variable

Evolución de Asset Allocation



	Situación actual	Media histórica	Máximo	Mínimo
Renta Variable	37,57 %	30,30 %	40,10 %	20,50 %
Renta Fija	48,07 %	39,93 %	52,06 %	27,80 %
Materias Primas	1,06 %	4,60 %	8,15 %	1,05 %
Liquidez	26,06 %	26,78 %	42,70 %	10,86 %
Gestión Alternativa	7,32 %	6,54 %	8,57 %	4,50 %

MUTUAFONDO EQUILIBRIO FI "A" (EUR) ACC

Desglose principales activos de la cartera

Cartera	Peso Octubre	Peso Noviembre	Evolución
Renta Variable	**-**	**-**	**↑ 29,66%**
Europa	**-**	**11,36%**	**11,36%**
ISHARES STOXX EUROPE 600 DE	-	0,90%	0,90%
MFS MER-EUROPEAN RES-I1	-	1,73%	1,73%
MUTUAFONDO BOLSA EUROPEA-L	-	3,75%	3,75%
FUT BUND	-	1,68%	1,68%
SX5E 12/17/21 C4200	-	0,43%	0,43%
FUT SX5E	-	0,79%	0,79%
SX5E 12/17/21 C4250	-	0,97%	0,97%
SX5E 02/18/22 C4250	-	0,59%	0,59%
SX5E 02/18/22 P3800	-	0,50%	0,50%
undefined	**-**	**2,37%**	**2,37%**
ISHR EUROPE600 OIL & GAS DE	-	0,91%	0,91%
BRANDES EURPN VALUE-I-EUR	-	1,47%	1,47%
Japón	**-**	**3,08%**	**3,08%**
ISHARES CORE MSCI JAPAN	-	3,08%	3,08%
Emergentes	**-**	**3,03%**	**3,03%**
ISHARES MSCI EM ACC	-	1,01%	1,01%
VF-MTX SUST EM MK LDR-HI H	-	1,17%	1,17%
X CSI300 SWAP 1C	-	0,85%	0,85%
USA	**-**	**5,13%**	**5,13%**
EDGEWOOD L SL-US SL G-I EURZ	-	3,41%	3,41%
X MSCI USA UCITS ETF	-	1,86%	1,86%
ESZ1C 4350	-	1,46%	1,46%
ESZ1P 4050	-	0,13%	0,13%
FUT EURUSD	-	-3,33%	-3,33%
FUT SPX	-	1,61%	1,61%
Global	**-**	**4,68%**	**4,68%**
ROBECO-ROB GL CON TR-IE	-	0,97%	0,97%
SCHRODER INTL-GL CLIM CH-CEA	-	1,67%	1,67%
WELL GLBL IMPACT FUND-S	-	1,32%	1,32%
UBS BLOOMBERG CMCI EMSN EUR	-	0,72%	0,72%
Mixtos	**-**	**-**	**↑ 1,99%**
Global	**-**	**1,99%**	**1,99%**
RUFFER SICAV-TOT RET IN-CEC	-	1,99%	1,99%
Renta Fija	**-**	**-**	**↑ 49,39%**
undefined	**-**	**22,70%**	**22,70%**
X ITRAXX CROSSOVER SH SWAP	-	3,73%	3,73%
MUTUAFONDO CORTO PLAZO-L	-	2,94%	2,94%
INVESCO EU ST BOND-Z ACC EUR	-	2,83%	2,83%
SPDR BBG EURO AGGREGATE	-	3,23%	3,23%
FIDELITY FDS-EU SHRT BD-IAE	-	2,84%	2,84%
NB ULTRA SHORT TERM EN CASH	-	2,89%	2,89%
LYXOR EUR GOVERNMENT BD 3-5Y	-	4,23%	4,23%

MUTUAFONDO EQUILIBRIO FI "A" (EUR) ACC

Desglose principales activos de la cartera

Cartera	Peso Octubre	Peso Noviembre	Evolución
Renta Fija	**-**	**-**	**↑ 49,39%**
USA	**-**	**0,83%**	**0,83%**
LYXOR USD 10Y INFL EXPECT	-	0,83%	0,83%
Global	**-**	**6,18%**	**6,18%**
AXA WLD-GL INF SH DUR-I EUR	-	1,00%	1,00%
G FUND-ALPHA FIXED INCOME-IC	-	2,26%	2,26%
DPAM L-BONDS UNIV UNCO-F	-	1,45%	1,45%
JUPITER JGF DY B FD-DEA	-	1,47%	1,47%
Emergentes	**-**	**3,32%**	**3,32%**
PRIN GL FIN UN EM FI-I3 HEDG	-	1,13%	1,13%
ISHARES CHINA CNY BOND USDHD	-	2,19%	2,19%
Europa	**-**	**16,35%**	**16,35%**
MUTUAFONDO RENTA FIJA FLEX-L	-	5,85%	5,85%
MUTUAFONDO-L	-	7,62%	7,62%
BLUEBAY INV GR EUR AGG BD-I	-	2,88%	2,88%
Retorno Absoluto	**-**	**-**	**↑ 4,95%**
undefined	**-**	**2,86%**	**2,86%**
BMO RLESTEQMKTNTRL AACCEUR	-	1,34%	1,34%
EXANE FUND 1-CERES FUND-A	-	1,52%	1,52%
Global	**-**	**2,09%**	**2,09%**
GAMCO-MERGER ARBITRAGE-A EUR	-	2,09%	2,09%
Divisa	**-**	**-**	**↑ 19,84%**
Japón	**-**	**0,00%**	**0,00%**
JPY	-	0,00%	0,00%
USA	**-**	**5,92%**	**5,92%**
USD	-	2,56%	2,56%
ROBECO BP US PREMIUM EQ-I-E	-	3,36%	3,36%
Europa	**-**	**13,89%**	**13,89%**
EUR	-	11,22%	11,22%
FUT BONO	-	-1,42%	-1,42%
FUT BOBL	-	4,09%	4,09%
undefined	**-**	**0,03%**	**0,03%**
GBP	-	0,03%	0,03%
Monetarios	**-**	**-**	**↓ -7,31%**
Europa	**-**	**-7,31%**	**-7,31%**
Residuo y Cash forward	-	-7,31%	-7,31%

Glosario

Ratio Sharpe

Medida de rentabilidad-riesgo que indica el exceso de rentabilidad por unidad de riesgo. Se calcula con los datos de los últimos 36 meses dividiendo el exceso de rentabilidad obtenida por el fondo (respecto al activo sin riesgo) por la desviación estándar del fondo. Cuánto mayor sea ese ratio de Sharpe mejor comportamiento habrá demostrado el fondo en el periodo analizado.

Volatilidad

Es una medida del riesgo del fondo, que indica si históricamente los valores liquidativos del fondo han experimentado variaciones importantes o si, por el contrario, han evolucionado de manera estable. Un fondo muy volátil tiene más riesgo porque es difícil prever si el valor liquidativo va a subir o a bajar. Por tanto, en el momento del reembolso, lo mismo podrían obtenerse ganancias significativas que pérdidas importantes.

Beta

Mide la sensibilidad del precio de un fondo de inversión a los movimientos registrados por un índice de referencia. Una beta de más de 1 indica que la rentabilidad histórica ha fluctuado más en comparación a la del índice de referencia, y por lo tanto supone una cartera de inversión más arriesgada que la del mercado. En el caso concreto de la cartera, se ha usado como índice de referencia el establecido para el cálculo de la comisión de éxito.

Alfa

Alfa mide la rentabilidad adicional alcanzada por un fondo contra un índice de referencia ajustado por Beta.

Max. Drawdown

Se define como el porcentaje de rentabilidad que se pierde desde un máximo de valor precedente (pico) hasta el mínimo alcanzado (valle).

Disclaimer

El contenido del presente documento tiene una finalidad meramente informativa, no es y no puede considerarse en ningún momento asesoramiento en materia de inversión u opinión legal, no pretendiendo reemplazar el asesoramiento necesario en esta materia y no constituyendo una oferta de venta o la petición de una oferta de compra.

Existe a disposición del público, para este fondo de Mutuactivos, S.A.U., SGIIC, folleto informativo completo, el documento con los datos fundamentales para el inversor, informes periódicos y última memoria anual auditada, que pueden solicitarse gratuitamente en el domicilio de la Sociedad Gestora, al teléfono 900 555 559 o en la web mutuactivos.com y en CNMV.

El inversor debe ser consciente de que este producto puede no ser adecuados para sus objetivos específicos de inversión, su posición financiera o patrimonial o su perfil de riesgo. Por consiguiente, deberá adoptar sus propias decisiones teniendo en cuenta dichas circunstancias y procurándose el asesoramiento especializado en materia fiscal, legal, financiera, regulatoria, contable o de cualquier otro tipo que, en su caso, precise. Rentabilidades pasadas no garantizan rentabilidades futuras. El valor y rendimiento de sus inversiones puede tanto bajar como subir. Las rentabilidades indicadas son netas descontando gastos y comisiones.