

Diagonal Sostenible

Informe de cartera
30 noviembre 2022



DESCRIPCIÓN

DIAGONAL SOSTENIBLE, SICAV (CODIGO ISIN: ES0115755003, TICKER S4124) permite el acceso al mercado global de renta variable mediante la inversión, principalmente a través de ETF, en aquellas compañías que cumplen con criterios éticos, sociales, ambientales y de buen gobierno corporativo (ESG)

Con este tipo de inversión, **los inversores pueden alinear sus valores personales hacia el entorno con sus inversiones financieras**, beneficiando a la sociedad gracias a la influencia, cada vez mayor, que tiene el mercado de capitales en el comportamiento social de las empresas con el objetivo de construir un mundo mejor.

POLÍTICA DE INVERSIÓN

DIAGONAL SOSTENIBLE SICAV invierte, directa o indirectamente a través de IIC, entre el 75% y el 100% de su patrimonio en renta variable.

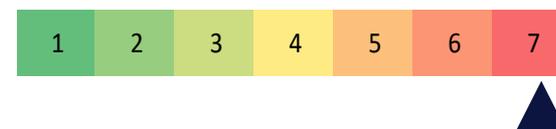
El objetivo de la cartera es conseguir rentabilidades positivas y sostenidas a largo plazo basándose en un universo de inversión que sea consistente con la idea de ser socialmente responsable en base a 3 criterios: Medioambientales, Sociales y de Buen Gobierno Corporativo (ESG).

Las compañías en las que se invertirá a través de ETFs se basan en criterios tanto de ESG como de coherencia con los principios y normas establecidas en las Declaración Universal de Derechos Humanos de la ONU.

DIAGONAL SOSTENIBLE SICAV es una sicav de renta variable por lo que el horizonte temporal recomendado de inversión es de 5 años

PERFIL DE RIESGO

Dado que **DIAGONAL SOSTENIBLE SICAV** estará habitualmente invertida entre un 75% y un 100% en Renta Variable presentará un nivel de volatilidad elevado.



INFORME DE GESTIÓN

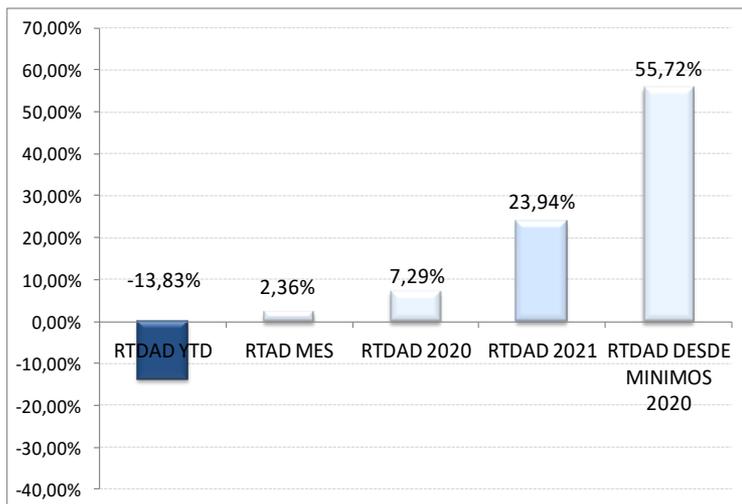
RESUMEN PATRIMONIAL

- Patrimonio a 31/12/2021: 11.233.536€ (821.274 acciones)
- Patrimonio a 30/09/2022: 8.684.263€ (779.961 acciones)
- Patrimonio a 30/11/2022: 8.626.365 € (731.885 acciones)

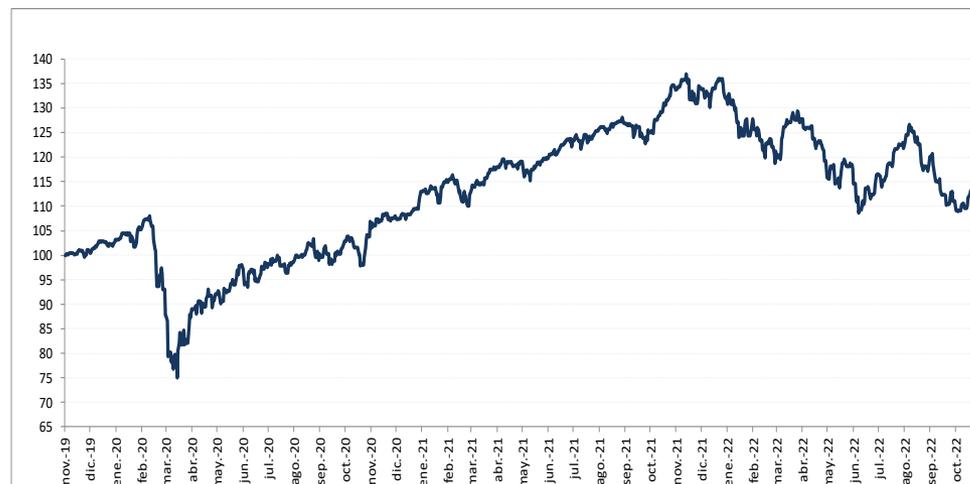
RESUMEN VALOR LIQUIDATIVO

- Valor Liquidativo a 31/12/2021: 13,67818
- Valor Liquidativo a 30/09/2022: 11,13423
- Valor Liquidativo a 30/11/2022: 11,78650

RENTABILIDAD DE LA SICAV



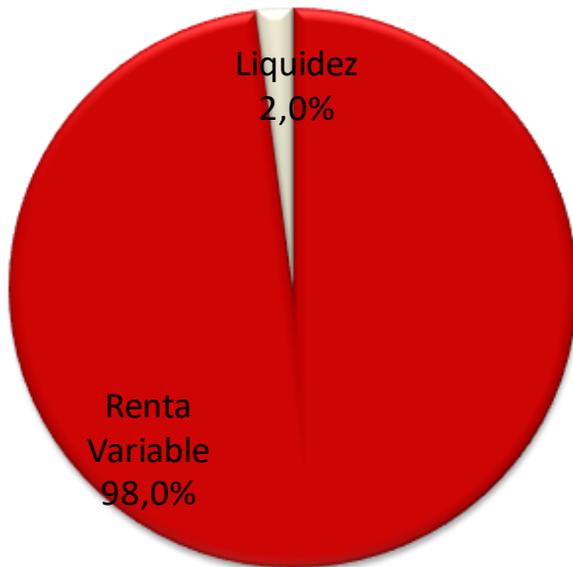
EVOLUCIÓN VALOR LIQUIDATIVO (BASE 100)



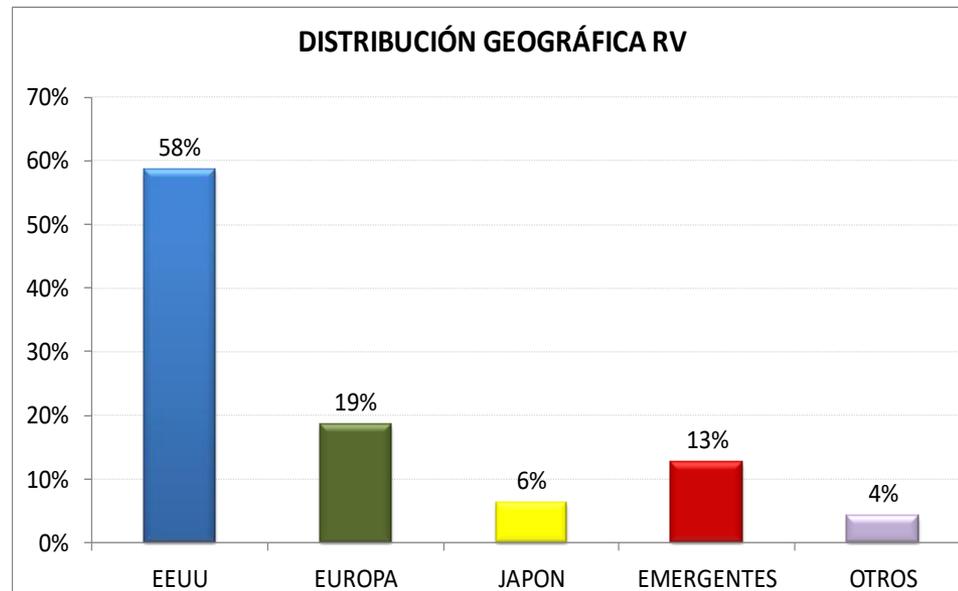
DIAGONAL SOSTENIBLE, SICAV

RENTABILIDAD ANUAL 2022	-13,83%
RENTABILIDAD MENSUAL	2,36%
RENTABILIDAD 2021	23,94%
RENTABILIDAD 2020	7,29%
RENTABILIDAD DESDE MÍNIMOS 2020	55,72%
VOLATILIDAD	15,54%

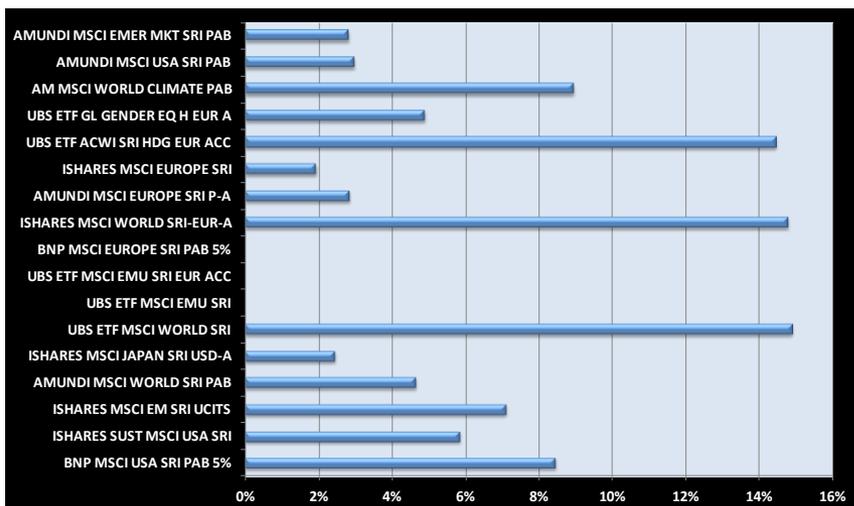
DISTRIBUCIÓN DE LA CARTERA



DISTRIBUCIÓN GEOGRÁFICA RV



PRINCIPALES POSICIONES DE CARTERA



EXPOSICIÓN NETA A DIVISA

USD	46,05%
GBP	2,67%
CHF	2,17%
JPY	5,19%
EMERGENTES	10,76%

SOSTENIBILIDAD CARTERA

ARTÍCULO 8 SFDR	67%
ARTÍCULO 9 SFDR	31%
ARTÍCULO 6 SFDR	0%
ND	0%

RIESGOS PRINCIPALES

Riesgo de crédito: Los inversores están expuestos al riesgo de impago de los bonos incluidos en cartera. Este riesgo puede afectar al 100% de la cartera. La materialización de este riesgo puede dar lugar a una disminución del valor liquidativo

Riesgo de contrapartida: El valor liquidativo puede verse afectado de manera negativa y sufrir pérdidas como resultado del incumplimiento de las contrapartidas de sus obligaciones contractuales

Riesgo de liquidez: El riesgo de liquidez puede materializarse en condiciones de mercado específicas y excepcionales que hagan difícil encontrar en el mercado contrapartidas o precios razonables

La inversión implica un riesgo. Las rentabilidades pasadas no son garantía ni indicación de resultados futuros.

Las inversiones están sujetas a las fluctuaciones del mercado y otros riesgos inherentes a la inversión, por lo que la rentabilidad de la misma así como el valor del principal de la inversión pueden experimentar variaciones tanto al alza como a la baja y dar lugar a la pérdida del importe invertido inicialmente.

← Potencialmente menor rendimiento			Potencialmente mayor rendimiento →			
← Menor riesgo			Mayor riesgo →			
1	2	3	4	5	6	7

Este dato es indicativo del riesgo de la sociedad y está calculado en base a datos históricos que, no obstante puede no constituir una indicación fiable del futuro perfil de riesgo. Además, no hay garantías de que la categoría indicada vaya a permanecer inalterable y puede variar a lo largo del tiempo.

¿Por qué en esta categoría? Es un nivel máximo de riesgo dadas las inversiones que podría llegar a realizar la SICAV aunque el riesgo podría ser inferior.

DISCLAIMER

*El contenido del presente documento ha sido elaborado por **Diagonal Asset Management SGIIC S.A.** con la finalidad de proporcionar información general. Este documento se proporciona exclusivamente con fines informativos y el análisis contenido en este documento no debe ser interpretado como consejos o recomendaciones de compra o venta ni una invitación de oferta para la inversión en el instrumento financiero.*

*La información contenida en este documento procede de fuentes fiables y, ha sido cuidadosamente verificada, no obstante **Diagonal Asset Management SGIIC S.A.** no manifiesta ni se hace responsable de las imprecisiones que puedan cometer las fuentes utilizadas.*

Dicha información está sujeta a cambios sin previo aviso.

***Diagonal Asset Management SGIIC S.A.** no asume compromiso alguno de comunicar dichos cambios ni de actualizar el contenido del presente documento.*

Toda persona que desee invertir en la SICAV mencionada en este documento, debe consultar el DFI, folleto completo. Además, el inversor que acceda al presente documento deberá tener en cuenta que los valores o instrumentos a los que se refiere pueden no ser adecuados a sus objetivos de inversión o a su posición financiera.

***Diagonal Asset Management SGIIC S.A.** no asume responsabilidad alguna derivada de cualquier posible pérdida, directa o indirecta, que pudiera derivarse del uso de la información contenida en este documento.*