

Portfolio Dynamic, SICAV

Informe mensual de cartera

31 de Agosto de 2026



INFORME DE GESTIÓN

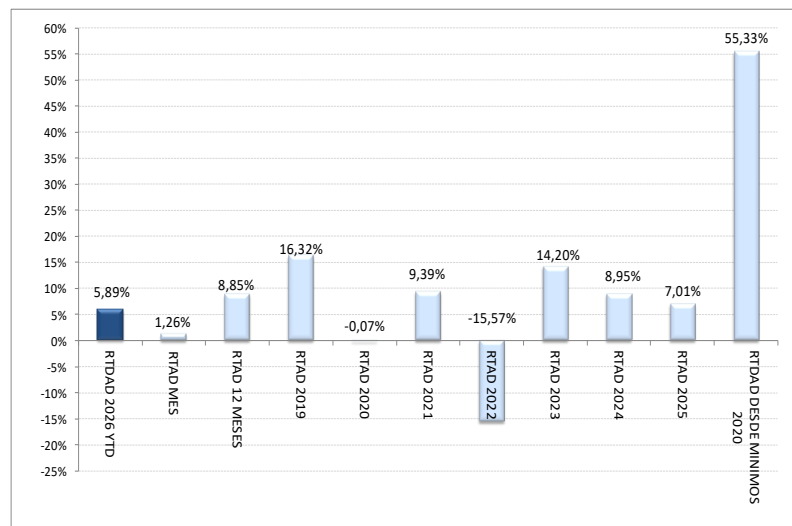
RESUMEN PATRIMONIAL

- Patrimonio a 31/12/2025: 18.298.994€ (1.209.737 acciones)
- Patrimonio a 30/06/2026: 19.720.812€ (1.242.673 acciones)
- Patrimonio a 31/08/2026: 19.876.362€ (1.240.962 acciones)

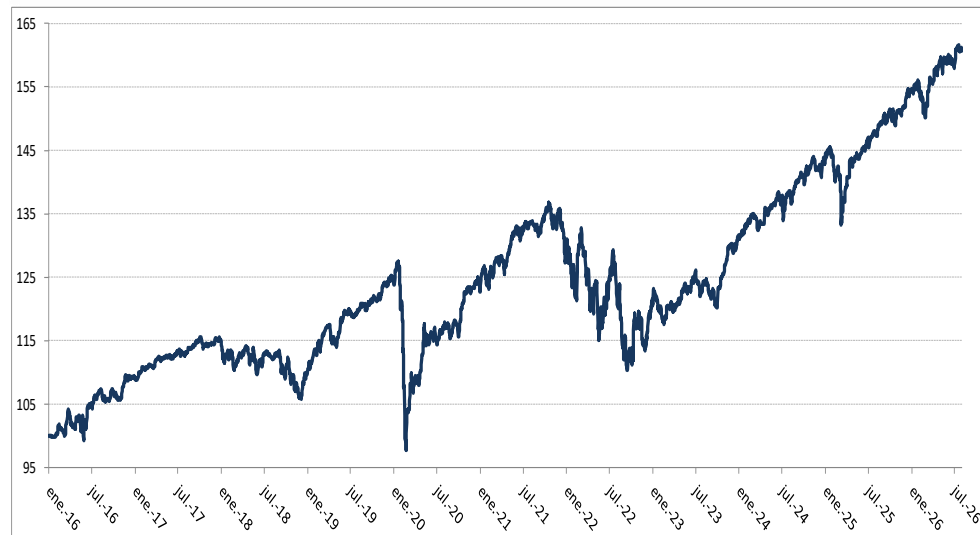
RESUMEN VALOR LIQUIDATIVO

- Valor Liquidativo a 31/12/2025: 15,126423
- Valor Liquidativo a 30/06/2026: 15,869671
- Valor Liquidativo a 31/08/2026: 16,016898

RENTABILIDAD DE LA SICAV



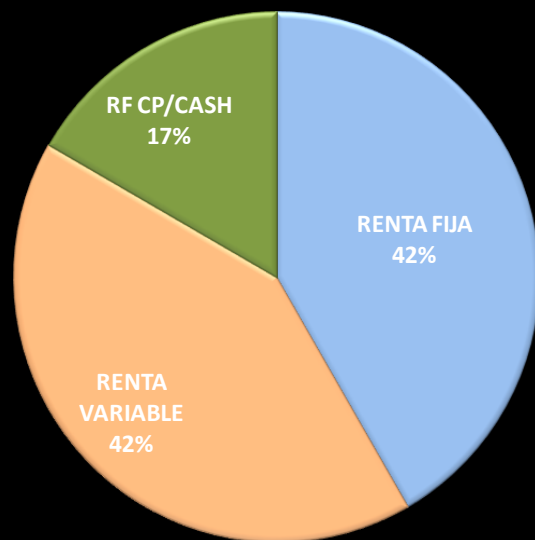
EVOLUCIÓN VALOR LIQUIDATIVO (BASE 100)



PORTFOLIO DYNAMIC SICAV, S.A.

RENTABILIDAD ANUAL 2026	5,89%
RENTABILIDAD MENSUAL	1,26%
RENTABILIDAD 12 MESES	8,85%
RENTABILIDAD 2025	7,01%
RENTABILIDAD 2024	8,95%
RENTABILIDAD 2023	14,20%
RENTABILIDAD 2022	-15,57%
RENTABILIDAD 2021	9,39%
RENTABILIDAD 2020	-0,07%
RENTABILIDAD 2019	16,32%
RENTABILIDAD DESDE MÍNIMOS 2020	55,33%
VOLATILIDAD	4,80%
RTDAD ABSOLUTA DESDE INICIO (ENE'16)	60,79%
TAE DESDE INICIO (ENERO 2016)	4,59%

DISTRIBUCIÓN DE LA CARTERA



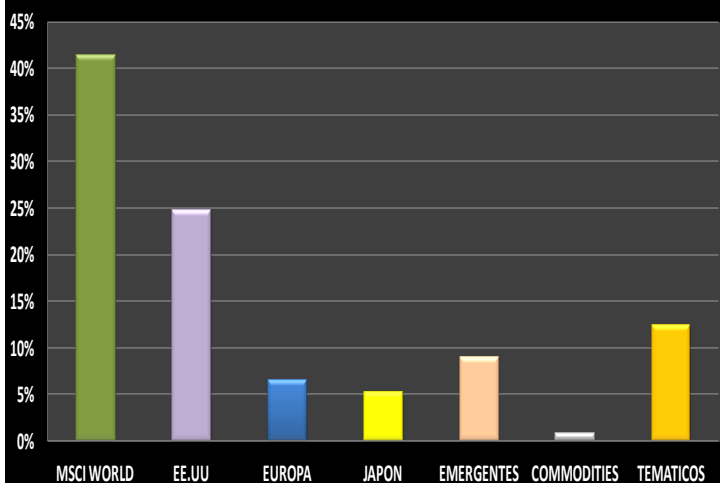
PRINCIPALES 10 POSICIONES EN CARTERA

SS SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD	9,72%
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM-IC	4,57%
ISHARES MSCI ALL COUNTRY WORLD	2,94%
SS SPDR S&P 500 UCITS ETF	2,80%
SS SPDR MSCI ALL COUNTRY WORLD	2,67%
ISHARES CORE MSCI EM IMI UCITS	2,56%
TIKEHAU 2027-I ACC EUR	2,55%
CGC CREDIT 2027-FEURACC	2,53%
ISHARES CORE MSCI WORLD UCITS	1,92%
GOLDMAN SACHS FUNDS SICAV - GO	1,83%

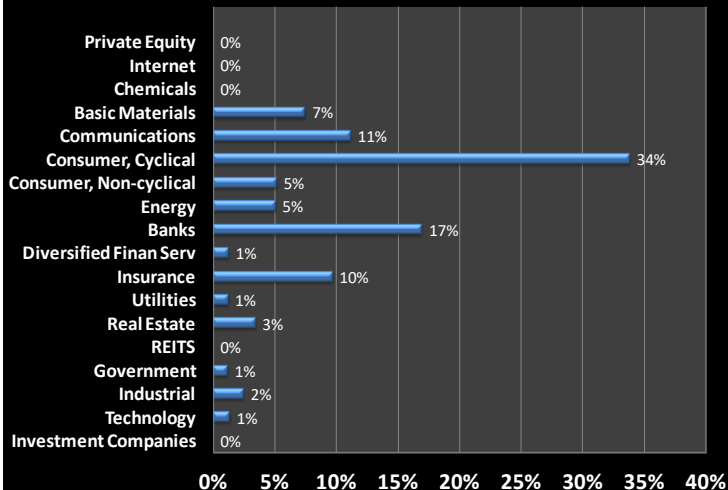
PARÁMETROS RENTA FIJA

DURACION	3,02
TIR PROMEDIO CALL	5,07
TIR PROMEDIO VTO	5,44
RATING MEDIO	BB+

DISTRIBUCIÓN RENTA VARIABLE



DISTRIBUCIÓN SECTORIAL RF

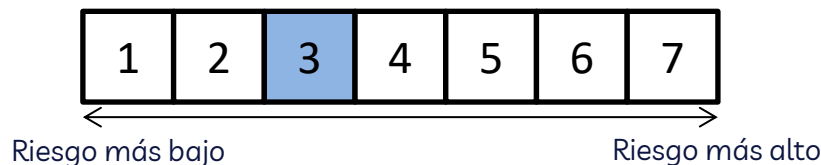


EXPOSICIÓN NETA DIVISA

USD	8,03%
GBP	1,09%
CHF	0,49%
YEN	2,94%

¿QUÉ RIESGOS CORRO Y QUÉ PODRÍA OBTENER A CAMBIO?

Indicador Resumido de Riesgo (IRR)



El indicador de riesgo presupone que usted mantendrá el producto durante 4 años

El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle. Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo 3 en una escala de 7, en la que 3 significa un riesgo medio bajo. Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como media baja y la probabilidad de que una mala coyuntura de mercado influya en nuestra capacidad de pagarle como improbable. Este producto no incluye protección alguna contra la evolución futura del mercado, por lo que podría perder una parte o la totalidad de su inversión. Si no podemos pagarle lo que se le debe, podría perder toda su inversión. El indicador de riesgo sólo tiene en cuenta el riesgo de mercado y de crédito.

Otros riesgos de importancia significativa para el PRIIP no incluidos en el indicador resumido de riesgos son los riesgos por inversión en países emergentes, riesgo de liquidez, riesgo por concentración geográfica o sectorial, el riesgo por inversión en instrumentos financieros derivados de apalancamiento, el riesgo por inversión en instrumentos financieros derivados de cobertura, y el riesgo de sostenibilidad.

DISCLAIMER

El contenido del presente documento ha sido elaborado por **Diagonal Asset Management SGIC 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 SGIC 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 SGIC S.A. no asume compromiso alguno de comunicar dichos cambios ni de actualizar el contenido del presente documento.

Esto es una comunicación publicitaria. Consulte el folleto completo y el documento de datos fundamentales para el inversor (DFI) antes de tomar una decisión final de inversión. 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 SGIC 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.