

Diagonal Rendimiento, FI

Informe mensual de cartera
30 de Junio de 2026



Diagonal
Asset Management



PRODUCTO

Denominación del producto: **DIAGONAL RENDIMIENTO, FI (ISIN: ES0115756001)**

DIAGONAL ASSET MANAGEMENT SGIIC, S.A. está autorizada en España y está regulada por la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV). <https://diagonalam.com>

Para más información llame al número de teléfono 936673138.

POLÍTICA DE INVERSIÓN

- Categoría: Fondo de Inversión **RENTA FIJA EURO CORTO PLAZO**.
- Plazo indicativo de la inversión: Este fondo puede no ser adecuado para inversores que prevean retirar su dinero en un plazo inferior a 1 año.
- Política de inversión: Se invierte **hasta el 100% de la exposición total en activos de renta fija pública y/o privada, incluidos depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, que sean líquidos**. En renta fija privada, no hay predeterminación en cuanto a emisores y/o mercados. En renta fija pública, principalmente en emisores y/o mercados de estados miembros de la zona euro. El Fondo podrá invertir un máximo del 15% en renta fija de mercados emergentes. **La duración media de la cartera no excederá del año**. Más del 75% de la exposición total se invertirá en emisiones con al menos calidad crediticia media (mínimo BBB-) o, si fuera inferior, el rating del Reino de España en cada momento, pudiendo tener hasta el 25% en baja calidad (inferior a BBB-) o sin rating. También podrá invertir hasta un 10% en acciones o participaciones de IIC financieras, que sean activo apto, armonizadas o no, pertenecientes o no al grupo de la gestora. La exposición al riesgo divisa no excederá el 10% de la exposición total. Se podrá invertir más del 35% del patrimonio en valores emitidos o avalados por un Estado de la UE, una Comunidad Autónoma, una Entidad Local, los Organismos Internacionales de los que España sea miembro y Estados con solvencia no inferior a la de España. La IIC diversifica las inversiones en los activos mencionados anteriormente en, al menos, seis emisiones diferentes. La inversión en valores de una misma emisión no supera el 30% del activo de la IIC.

INFORME DE GESTIÓN

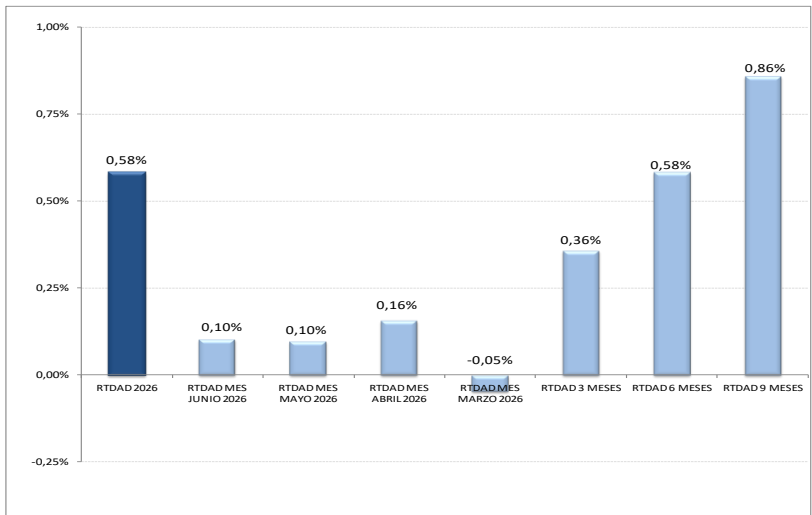
RESUMEN PATRIMONIAL

- Patrimonio a 31/12/2025: 1.747.829 € (1.754.989 participaciones)
- Patrimonio a 31/03/2026: 1.751.750 € (1.754.989 participaciones)
- Patrimonio a 30/06/2026: 1.098.989 € (1.097.102 participaciones)

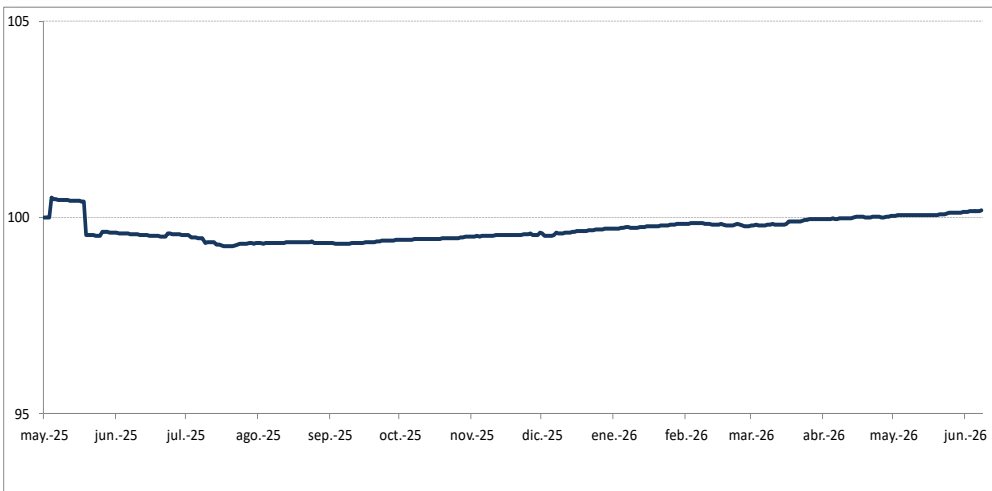
RESUMEN VALOR LIQUIDATIVO

- Valor Liquidativo a 31/12/2025: 0,995921
- Valor Liquidativo a 31/03/2026: 0,998155
- Valor Liquidativo a 30/06/2026: 1,001720

RENTABILIDAD DEL FONDO



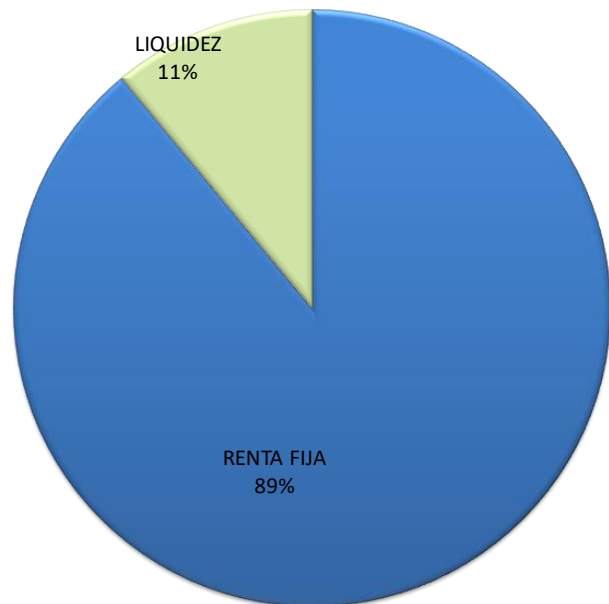
EVOLUCIÓN VALOR LIQUIDATIVO (BASE 100)



DIAGONAL RENDIMIENTO, FI

RENTABILIDAD ANUAL 2026	0,58%
RENTABILIDAD JUNIO 2026	0,10%
RENTABILIDAD MAYO 2026	0,10%
RENTABILIDAD ABRIL 2026	0,16%
RENTABILIDAD MARZO 2026	-0,05%
RENTABILIDAD A 3 MESES	0,36%
RENTABILIDAD A 6 MESES	0,58%
RENTABILIDAD 9 MESES	0,86%
VOLATILIDAD (ANUALIZADA 90 DIAS)	0,20%

DISTRIBUCIÓN DE LA CARTERA



PARAMETROS RENTA FIJA

DURACION

0,37

TIR PROMEDIO VTO (YTM)

2,63

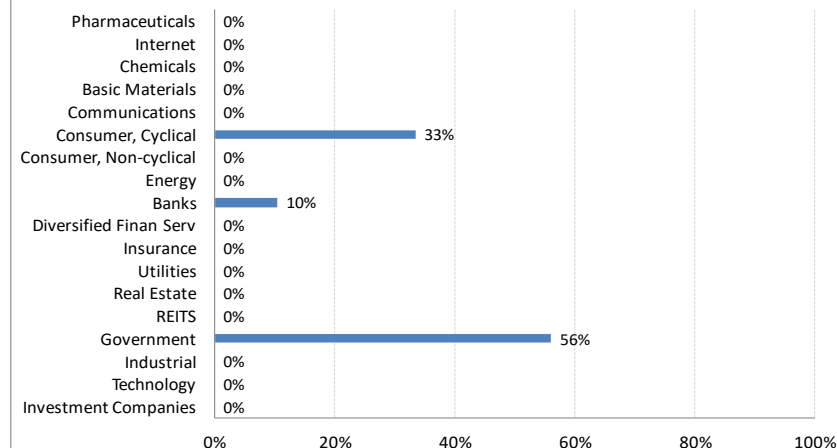
RATING PROMEDIO

A-

PRINCIPALES 10 POSICIONES EN CARTERA

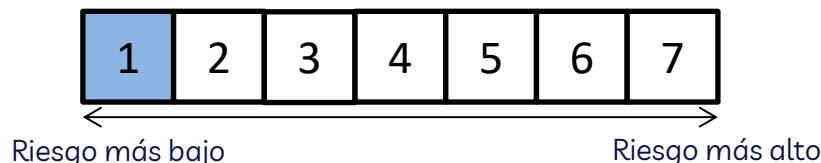
AMADEUS IT GROUP SA	AMSSM 1 1/2 09/18/26	9,19%
BMW INTL INVESTMENT BV	BMW 3 08/27/27	7,01%
CONTINENTAL AG	CONGR 2 1/2 08/27/26	6,97%
BAYER AG	BAYNGR 4 08/26/26	6,60%
SPAIN LETRAS DEL TESORO	SGLT 0 07/10/26	5,91%
FRANCE (GOVT OF)	FRTR 0 02/25/27	5,82%
ROMANIA	ROMANI 2 12/08/26	5,48%
BUONI POLIENNALI DEL TES	BTPS 0.85 01/15/27	5,44%
UNICREDIT SPA	UCGIM 3 1/4 07/27/27	4,70%
GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS 1 5/8 07/27/26	4,62%

DISTRIBUCIÓN SECTORIAL RF



¿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 1 año

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 1 en una escala de 7, en la que 1 significa el riesgo más bajo. Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como muy baja y la probabilidad de que una mala coyuntura de mercado influya en nuestra capacidad de pagarle como muy 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. Otros riesgos de importancia significativa no incluidos en el indicador resumido de riesgos son los riesgos de mercado, como el tipo de interés y de tipo de cambio, riesgo por inversión en países emergentes, riesgo de crédito, riesgo de liquidez, el riesgo por inversión en instrumentos financieros derivados y el riesgo de sostenibilidad. Cualquier otro riesgo no incluido en el Indicador Resumido de Riesgo está descrito en el folleto de la sociedad. Este producto no incluye protección alguna contra la evolución futura del mercado, por lo que podría perder parte o la totalidad de su inversión. Si no se le puede pagar lo que se le debe, podría perder toda su inversión.

La inversión puede conllevar, entre otros, un riesgo de tipo de interés, de tipo de cambio, de inversión en países emergentes, de concentración geográfica o sectorial, de crédito, de liquidez, así como por el uso de instrumentos financieros derivados. Riesgo de sostenibilidad. Consulte el folleto para más información. 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.

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.

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 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.