

Smart Crypto Portfolio

INFORME MENSUAL NOVIEMBRE 2020

ACCURATE QUANT

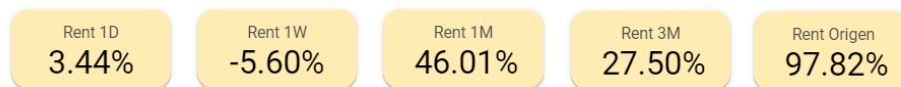
Comentario Mensual

La estrategia termina noviembre con una rentabilidad de 40.5% lo que deja la rentabilidad de 2020 en + 138.52%.

Muy buen comportamiento de todas los componentes de la cartera, impulsando la rentabilidad de una forma diversificada y sin tanta dependencia de Bitcoin, donde solo hemos tenido alrededor del 11-14%.

Gran parte del movimiento en el Asset Class se ha debido a un mayor interés institucional por las criptodivisas, lo que ha mejorado mucho las expectativas futuras en cuanto a regulación.

Métricas históricas de la Estrategia:



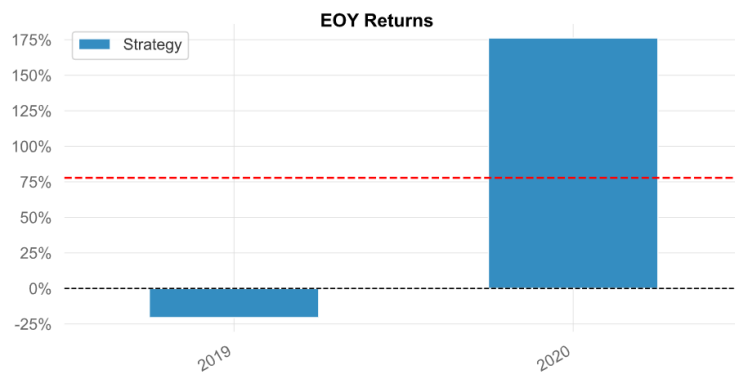
AÑO	JAN	FEB	MAR	APR	MAY	JUN	JUL	AUG	SEP	OCT	NOV	DEC	EOY
2019	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	10.21%	-16.22%	-13.99%	-18.87%
2020	46.21%	-1.94%	-36.11%	43.27%	2.36%	-7.65%	35.99%	28.4%	-18.46%	5.24%	40.05%	6.15%	138.52%

Métricas de la Estrategia	
Volatilidad	68.78%
Máx Drawdown	-61.69%
Mejor Mes	46.21%
Peor Mes	-36.11%
Sharpe	1.08
Sortino	1.48
Calmar	1.68
Skew	-1.81
Kurtosis	20.12

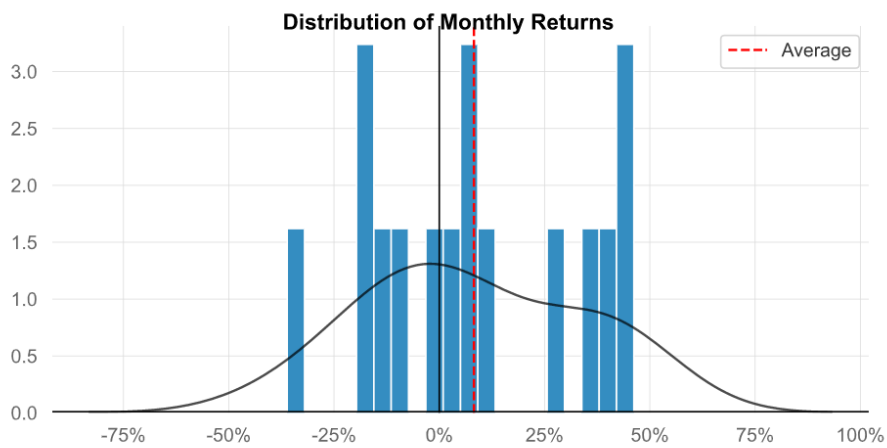
Gráfico histórico de la Estrategia:



Análisis anual de la Estrategia:



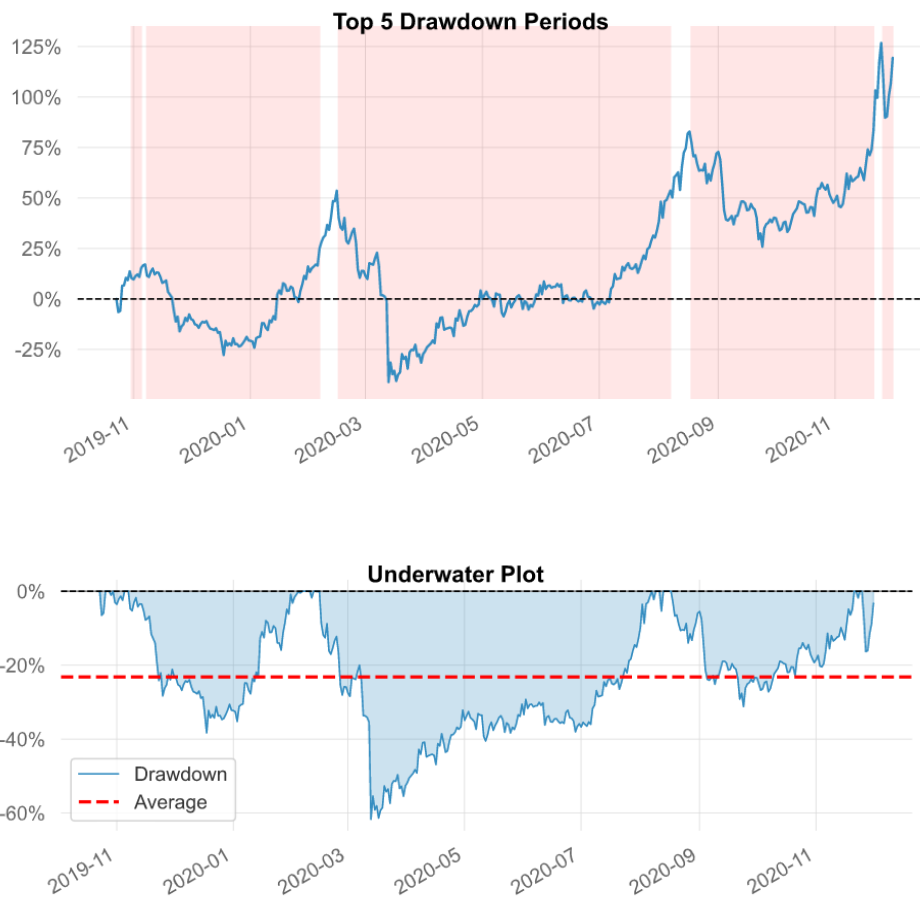
Análisis mensual de la Estrategia:



Análisis diario de la Estrategia:



Análisis de DrawDowns de la Estrategia:



Notas Importantes:

- Accurate Quant no es una Entidad de Servicios de Inversión regulada por la C.N.M.V, por lo que esta información no implica ningún tipo de asesoramiento o recomendación.
- Esta estrategia es ofrecida por una tercera entidad independiente de Accurate Quant, y será la responsable final de analizar la idoneidad y/o conveniencia de ofrecer sus productos a sus clientes, y de la rentabilidades o pérdidas que puede conllevar replicar la estrategia.
- Este informe tiene una finalidad divulgativa por lo que Accurate Quant no se hace responsable de posibles errores o inexactitudes que pueda contener.
- Le recomendamos que se asesore convenientemente antes de efectuar cualquier tipo de inversión.