

Global Assets Portfolio

INFORME MENSUAL NOVIEMBRE 2020

ACCURATE QUANT

Comentario Mensual

YIR termina Noviembre con una rentabilidad de +2.14% lo que deja la rentabilidad de 2020 en + 1.26%.

La estrategia vuelve en así a obtener rentabilidad positiva en noviembre después de que septiembre y octubre mostraran rendimientos negativos tras cuatro meses de rentabilidades positivas desde mayo a agosto .

En Renta Variable la estrategia tenía como objetivo correcciones bajistas ante el fuerte movimiento alcista que hemos visto en las bolsas a nivel global, posicionándose así corto en S&P500, Nasdaq 100, Eurostoxx50 y Dax.

En divisa las posiciones principales han sido en AUDNZD, GBPUSD, EURNOK, USDSEK y EURJPY, con el AUDNZD y USDSEK como los pares de divisas con más volatilidad durante el mes, seguidos de GBPUSD Y EURNOK.

Métricas históricas de la Estrategia:

AÑO	JAN	FEB	MAR	APR	MAY	JUN	JUL	AUG	SEP	OCT	NOV	DEC	EOY
2008	-3.52%	1.2%	4.88%	2.51%	2.25%	-0.81%	3.85%	-2.17%	5.52%	2.18%	18.51...	3.45%	36.88...
2009	0.61%	8.1%	7.89%	3.83%	4.59%	4.5%	-4.16%	1.84%	1.94%	2.89%	2.19%	0.73%	34.76...
2010	1.28%	1.08%	0.69%	0.28%	3.1%	2.31%	0.85%	2.55%	-0.22%	0.75%	2.7%	-0.43%	15.1%
2011	0.77%	0.05%	2.44%	-1.47%	-1.54%	2.67%	-1.7%	-2.7%	-0.11%	1.03%	4.9%	1.86%	6.72%
2012	1.09%	0.76%	1.14%	0.23%	0.34%	2.63%	-1.97%	0.27%	-0.47%	0.63%	0.72%	-0.99%	4.43%
2013	0.02%	2.88%	-0.23%	-0.81%	-0.3%	1.58%	-2.87%	1.04%	0.46%	0.46%	0.31%	-0.55%	1.98%
2014	0.87%	0.61%	2.61%	0.76%	-0.63%	-0.39%	-2.1%	-0.02%	-1.3%	3.13%	0.9%	0.23%	4.73%
2015	1.25%	2.23%	0.42%	-1.99%	-0.87%	-1.51%	-3.06%	3.91%	2.66%	1.99%	0.23%	2.94%	8.42%
2016	1.88%	3.57%	1.73%	-1.31%	1.12%	4.24%	1.52%	0.77%	-0.04%	-1.76%	1.58%	-0.05%	13.38...
2017	2.06%	0.48%	0.17%	0.27%	-0.26%	-0.54%	0.79%	0.91%	-0.55%	1.38%	0.56%	-0.03%	5.29%
2018	1.29%	-1.08%	1.29%	0.15%	1.37%	0.26%	1.81%	0.07%	0.28%	1.02%	1.32%	2.09%	10.05...
2019	1.92%	1.33%	0.55%	-0.7%	0.28%	0.62%	-0.37%	4.34%	0.93%	1.34%	0.02%	-0.3%	10%
2020	1.9%	-8.06%	0.75%	-3.18%	4.72%	1.81%	3.64%	-0.9%	-1.27%	-1.33%	2.14%	0%	1.26%

Rentabilidad Anual Origen
10.31%

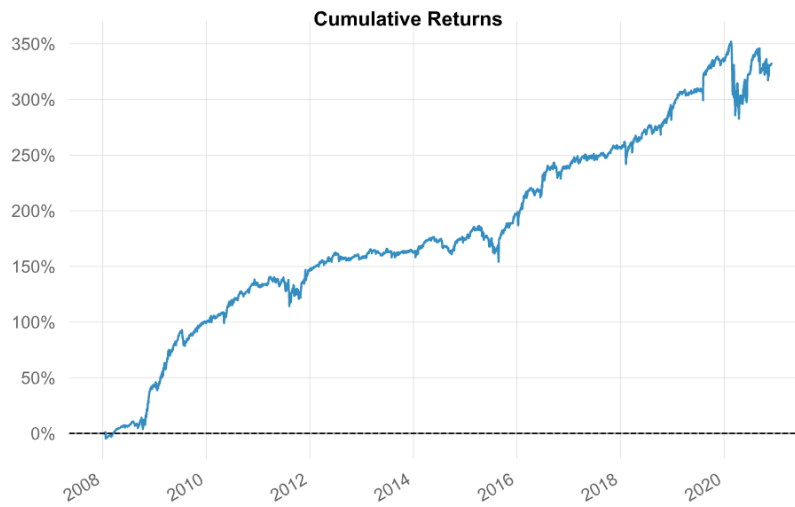
Volatilidad
9.14%

Drawdown
-15.35%

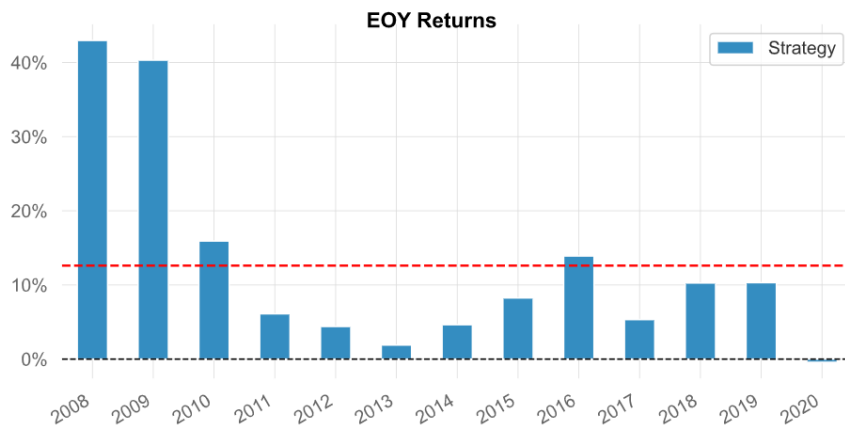
Mejor_Mes
18.51%

Peor_Mes
-8.06%

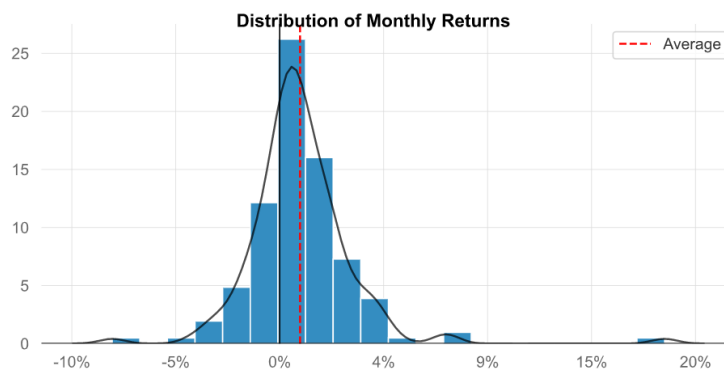
Gráfico histórico de la Estrategia:



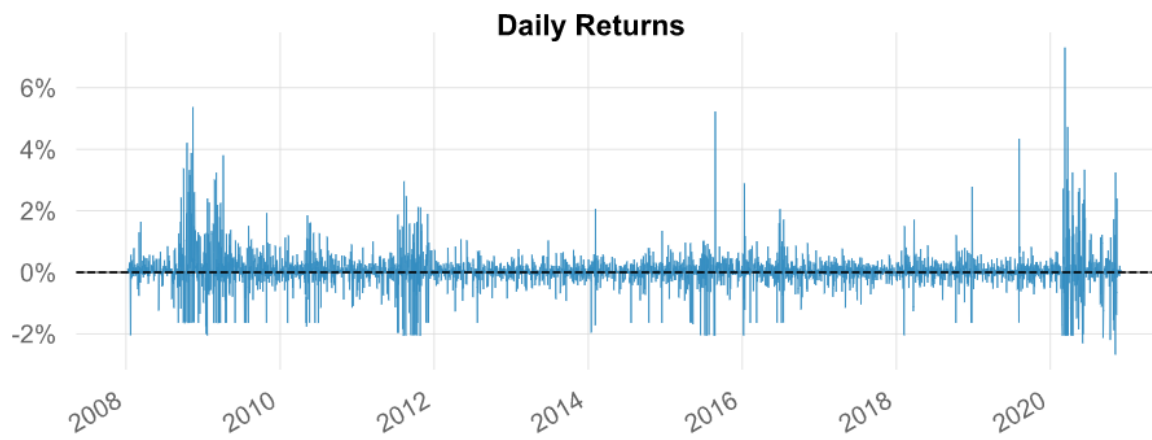
Análisis anual de la Estrategia:



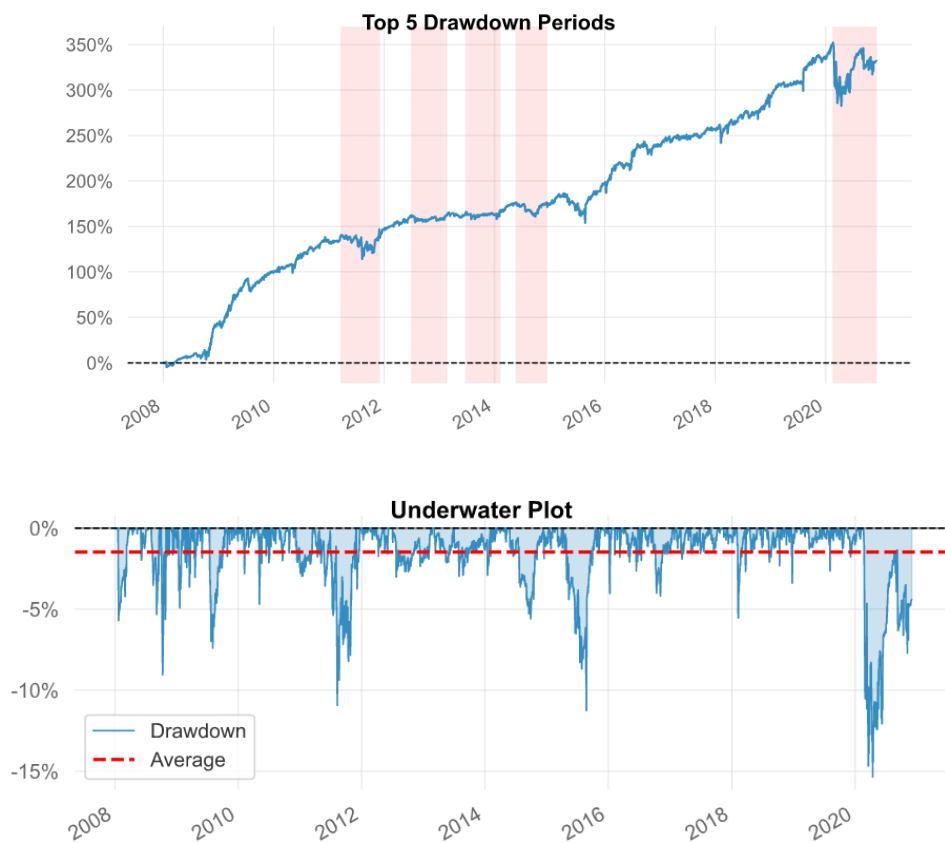
Análisis mensual de la Estrategia:



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.