

Global FX Portfolio

INFORME MENSUAL NOVIEMBRE 2020

ACCURATE QUANT

ACCURATE QUANT, S.A | Calle Serrano 93, 28006- Madrid

Comentario Mensual

La Estrategia Global FX Portfolio termina noviembre con una rentabilidad de +4.03% lo que deja la rentabilidad de 2020 en + 16.77%.

La estrategia continua el comportamiento positivo que mostro en Octubre y se ha debido principalmente a posiciones 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:

YEAR	JAN	FEB	MAR	APR	MAY	JUN	JUL	AUG	SEP	OCT	NOV	DEC	YTD
2010	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	-1.04%	6%	6.12%	-1.15%	10.04%
2011	0.1%	1.73%	2.83%	-0.25%	-3.09%	0.13%	1.95%	6.6%	0.8%	3.67%	-2.75%	3.6%	15.97%
2012	0.29%	3.62%	-2.16%	1.16%	3.69%	3.67%	4.54%	2.43%	-0.5%	2.76%	0.03%	-5.9%	13.94%
2013	4.88%	4.24%	3.48%	3.09%	3.84%	-0.2%	-4.38%	0.27%	2.2%	4.76%	3.51%	-1.65%	26.3%
2014	2.18%	-3.48%	4.17%	1.32%	0.68%	-1.53%	-5.93%	2.47%	-2.34%	11.2...	0.77%	6.12%	15.61%
2015	12.3...	4.75%	-1.22%	2.11%	0%	2.14%	-1.31%	7.11%	-1.29%	4.17%	3.81%	5.83%	44.83%
2016	1.64%	0.81%	6.22%	-0.51%	3.51%	1.85%	0.72%	1.35%	-2.55%	-4.16%	1.89%	3.81%	15.12%
2017	7.36%	-3.43%	0.91%	2.75%	5.33%	-2.52%	4.6%	3.06%	-2.73%	5.27%	4.22%	2.12%	29.67%
2018	0%	5%	3.83%	-0.88%	-0.63%	-0.51%	-0.19%	-3.99%	6.29%	5.83%	1.57%	-0.73%	16.11%
2019	3.09%	5.48%	0.26%	0.56%	-0.47%	3.17%	-4.73%	0.17%	2.42%	-2.41%	-1.52%	-5.11%	0.35%
2020	4.52%	3.14%	-4.06%	0.26%	-0%	2.59%	3.04%	1.08%	-1.98%	3.35%	4.03%	0%	16.77%

Rentabilidad Anual Origen

13.87%

Volatilidad

5.19%

Drawdown

-12.62%

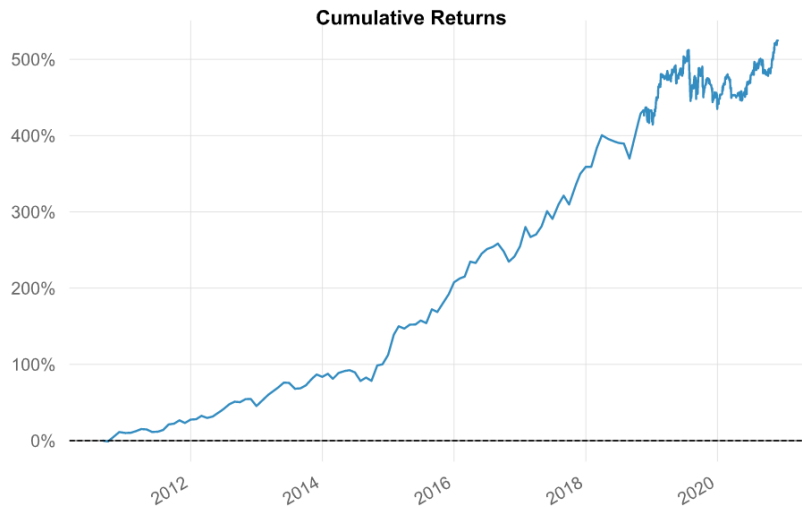
Mejor_Mes

12.39%

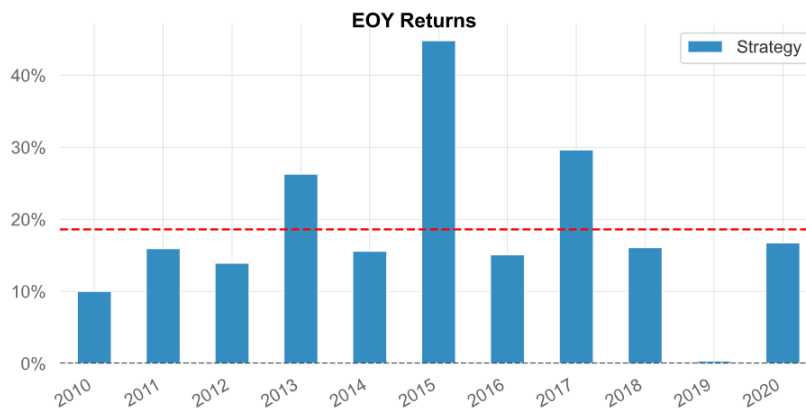
Peor_Mes

-5.93%

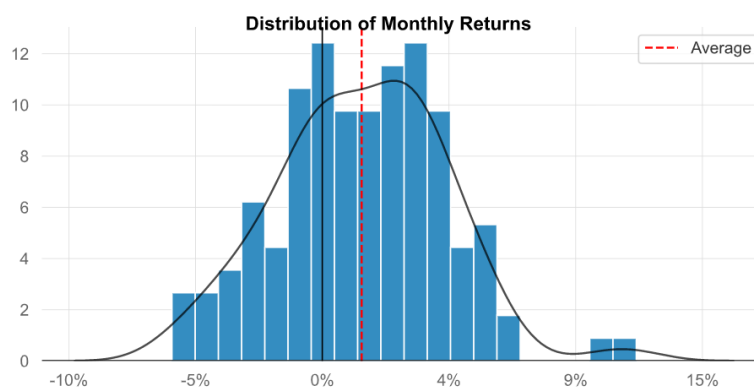
Gráfico histórico de la Estrategia:



Análisis anual de la Estrategia:



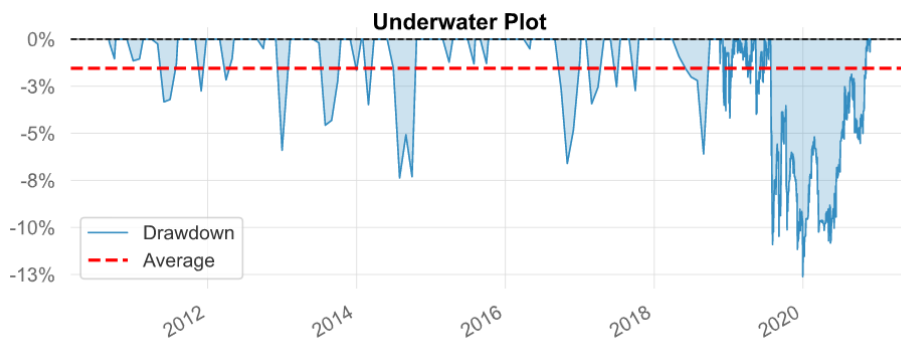
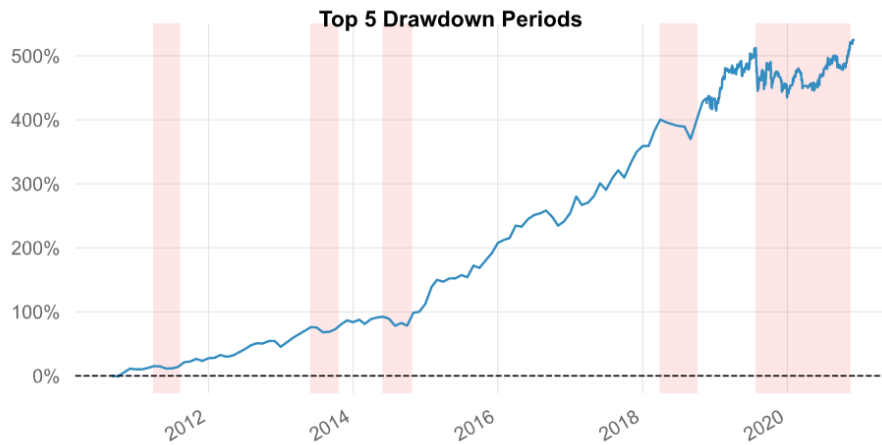
Análisis mensual de la Estrategia:



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.