

Retornos Mensuales

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	AÑO
2020	-5,47	-7,06	-23,29	4,71	3,62	-0,55							-27,29
2019	6,91	2,10	-0,58	2,16	-7,39	5,13	-0,63	-5,52	2,24	1,25	4,30	1,84	11,44
2018	3,43	-2,16	0,11	2,79	-0,87	0,05	0,35	-1,41	-0,74	-5,38	0,70	-5,64	-8,80
2017	0,16	3,19	3,60	3,43	2,17	-2,04	-0,53	-1,76	-0,13	2,53	-2,34	0,24	8,59
2016	-6,12	0,54	1,82	3,21	2,00	-3,19	6,45	1,11	1,72	-0,32	-0,16	5,05	12,14
2015	5,56	5,56	2,71	-0,87	0,81	-3,55	0,27	-5,98	-7,24	9,37	2,50	-4,56	3,21
2014	2,32	1,90	2,47	0,54	1,75	2,53	-3,04	-0,34	-1,99	-2,09	3,00	-3,31	3,50
2013	3,28	4,25	-0,24	5,26	0,49	-0,51	8,08	-1,31	6,52	6,54	0,66	0,80	38,82
2012	2,16	0,08	-0,34	-3,97	-8,91	9,42	-0,07	5,95	4,89	3,81	-2,45	6,36	16,64
2011	5,99	1,98	1,93	2,78	-1,87	-2,06	-3,09	-6,37	-4,72	1,23	-2,72	1,36	-6,10
2010	-3,04	-3,33	3,41	-3,51	-9,09	-3,42	8,84	-1,74	2,98	4,06	-10,87	8,48	-9,00
2009	-3,47	-7,61	-0,55	17,87	5,64	0,65	6,68	3,92	3,71	-5,11	0,97	3,60	26,84
2008	-8,86	3,00	2,05	2,16	0,16	-8,83	-3,25	0,41	-11,16	-16,07	-4,09	1,25	-37,14
2007	2,68	0,43	4,16	-0,84	3,70	-3,04	-0,20	-3,35	-1,85	6,61	-2,64	-3,57	1,47
2006	5,61	5,92	1,39	0,95	-3,82	0,79	3,26	1,81	5,36	4,77	4,13	3,24	38,45
2005	4,11	1,25	-1,06	-1,11	5,14	4,61	2,93	1,06	6,49	-3,92	0,85	1,77	23,91

Retornos Acumulados

	YTD	1 Año	2 Años	3 Años	5 Años	7 Años	10 Años	15 Años	20 Años
EDM Inversión	-27,29	-24,94	-28,46	-27,61	-15,81	18,04	61,97	62,75	134,69
IBEX 35	-24,27	-21,39	-24,85	-30,76	-32,85	-6,84	-21,94	-26,08	-31,66

Retornos Anualizados

	YTD	1 Año	2 Años	3 Años	5 Años	7 Años	10 Años	15 Años	20 Años
EDM Inversión	-27,29	-24,94	-15,42	-10,21	-3,38	2,40	4,94	3,30	4,36
IBEX 35	-24,27	-21,39	-13,31	-11,53	-7,66	-1,01	-2,45	-1,99	-1,89

Volatilidad Anualizada

	1 Año	2 Años	3 Años	5 Años	7 Años	10 Años	15 Años	20 Años
EDM Inversión	26,97	21,50	17,95	16,52	15,37	15,61	16,49	15,87
IBEX 35	24,75	19,97	17,38	18,03	17,10	19,30	19,50	19,60

Ratio Sharpe

	1 Año	2 Años	3 Años	5 Años	7 Años	10 Años	15 Años	20 Años
EDM Inversión	-0,90	-0,64	-0,48	-0,10	0,24	0,38	0,21	0,25
IBEX 35	-0,82	-0,59	-0,59	-0,33	0,04	-0,04	-0,06	-0,08

Ratio Sortino

	1 Año	2 Años	3 Años	5 Años	7 Años	10 Años	15 Años	20 Años
EDM Inversión	-0,95	-0,71	-0,54	-0,12	0,32	0,52	0,29	0,34
IBEX 35	-0,86	-0,64	-0,65	-0,40	0,05	-0,05	-0,08	-0,11

Correlación con su Categoría

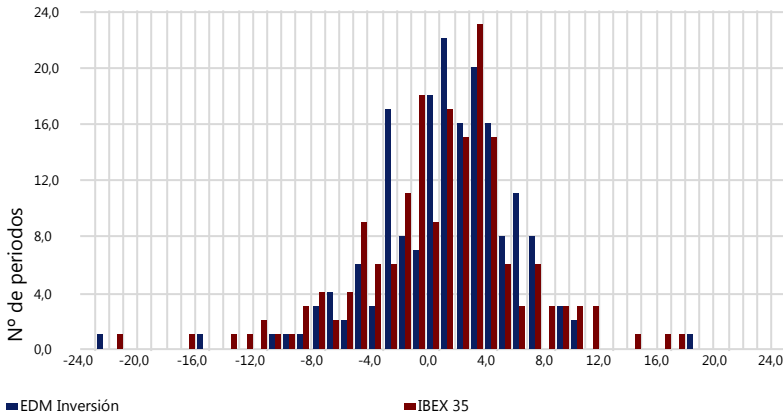
	1 año	2 años	3 años	5 años	7 años	10 años	15 años	20 años
Alpha	-0,27	-1,91	1,08	3,14	3,25	6,46	4,44	5,08
Beta	1,04	1,02	0,95	0,81	0,80	0,71	0,76	0,73
Return	-24,94	-15,42	-10,21	-3,38	2,40	4,94	3,30	4,36
Ratio de Información	-1,88	-0,34	0,21	0,56	0,44	0,82	0,62	0,72
Tracking Error	2,41	7,11	7,10	8,32	7,75	9,28	8,74	8,79
Correlación	0,95	0,94	0,92	0,89	0,89	0,88	0,90	0,90
R2	90,54	89,07	84,56	78,79	79,45	77,40	80,25	80,79

Riesgo Estadístico

	1 Año	2 Años	3 Años	5 Años	7 Años	10 Años	15 Años	20 Años
Up Capture Ratio	119,01	103,48	93,16	88,26	88,85	86,77	87,11	86,56
Down Capture Ratio	118,19	109,53	91,03	75,83	74,84	60,81	68,79	65,02
Longest Down-Streak Start Date	01/01/2020	01/01/2020	01/01/2020	01/06/2017	01/06/2017	01/05/2011	01/05/2011	01/05/2011
Longest Down-Streak End Date	31/03/2020	31/03/2020	31/03/2020	30/09/2017	30/09/2017	30/09/2011	30/09/2011	30/09/2011
Down Number	6,00	12,00	18,00	26,00	34,00	49,00	73,00	99,00
Up Number	6,00	12,00	18,00	34,00	50,00	71,00	107,00	141,00
Best Quarter	7,90	8,52	8,52	9,49	14,45	14,45	25,32	25,32
Worst Quarter	-32,61	-32,61	-32,61	-32,61	-32,61	-32,61	-32,61	-32,61
Gain/Loss Ratio	0,42	0,55	0,62	0,90	1,22	1,36	1,25	1,31
Max Drawdown	-32,61	-33,92	-34,24	-34,27	-34,27	-34,27	-48,78	-48,78
Overall Deviation	2,33							
Overall Capture Ratio	1,01	0,94	1,02	1,16	1,19	1,43	1,27	1,33

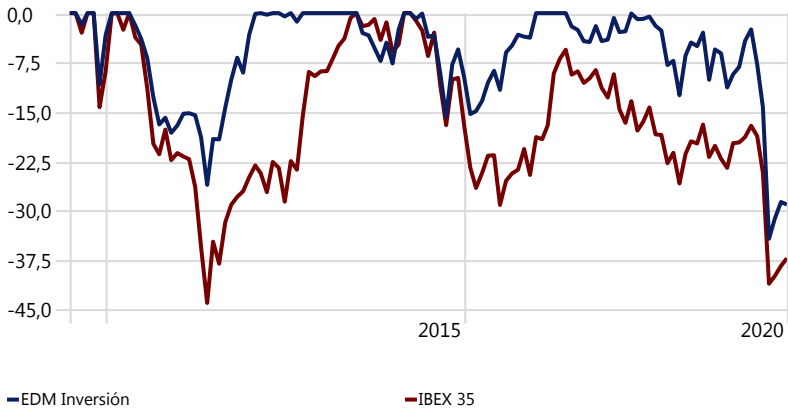
Histograma de Retornos

Time Period: 01/07/2005 to 30/06/2020

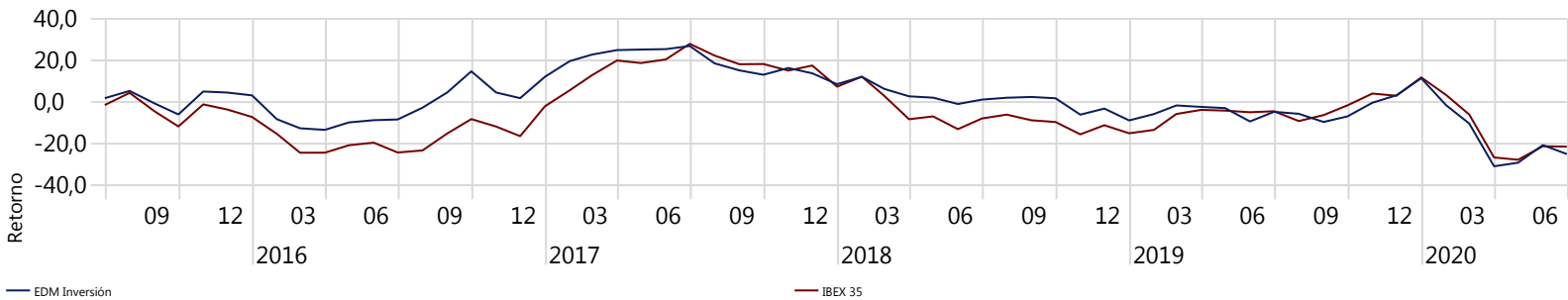


Drawdown Chart

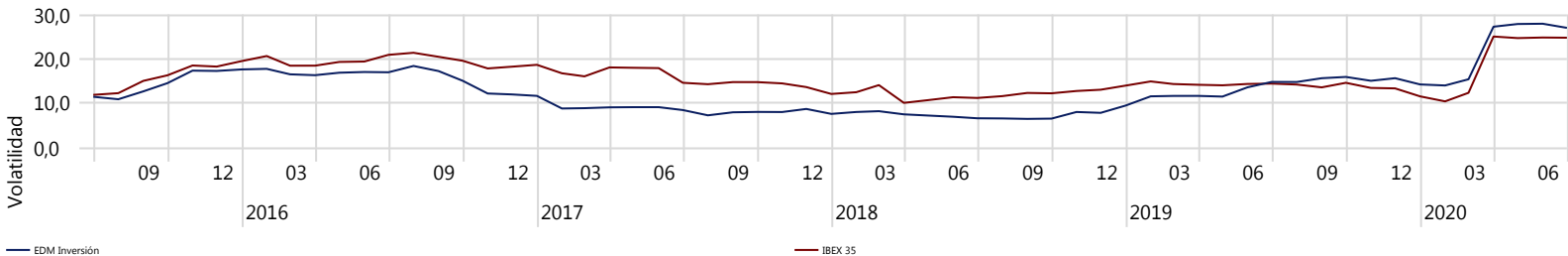
Time Period: 01/07/2010 to 30/06/2020



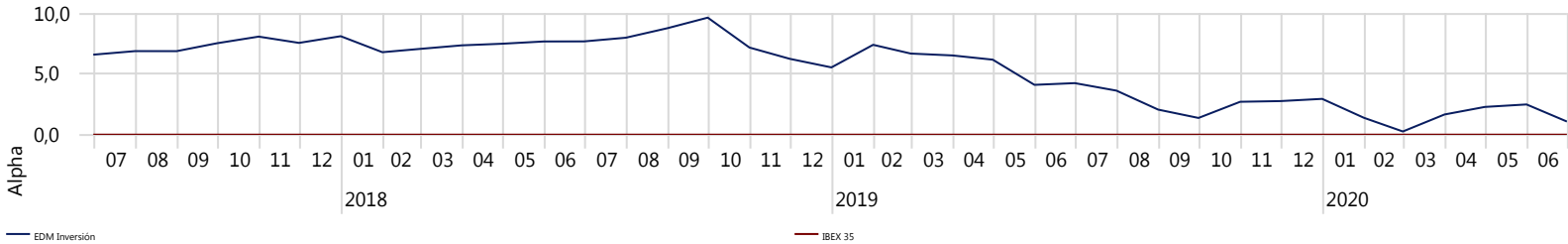
12M Rolling Retornos Anualizados



12M Rolling Volatilidad Anualizada



3 Años Rolling Alpha



3 Años Rolling Beta

