

Portfolio Hedge - Clase A

Información	
Gestora	GlobalFinanzas IG, AV, SA
Forma Jurídica	Mandato de Gestión
Divisa	EUR
Categoría	Tail Risk Hedge. Long Vol
Comisión Gestión	2% + IVA
Comisión Éxito	0%

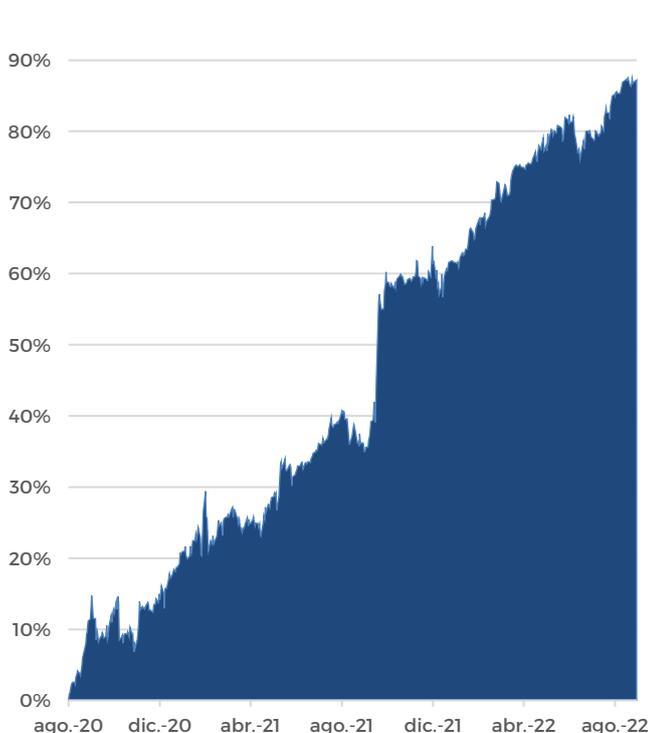
	S&P 500		PORTFOLIO HEDGE	
	Total Return	Inverso (Benchmark)	Relativo BM	Absoluto
Resultado Neto	+24%	-26%	+87%	+62%
Resultado Anualizado	+11%	-13%	+38%	+25%
Máximo Drawdown	-23%	-36%	+22%	-13%
Volatilidad Anualizada	18%	18%	+1%	18%
Correlación S&P 500	1,0	-1,0	+0,4	-0,6

Resultados Mensuales (%)																
Año	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Vola.	M. DD	S&P	HEDGE
2020								+4,7	+3,5	-2,6	-3,2	+3,7	14,8	-9,0	+15,4	+6,0
2021	+6,0	-3,1	-3,7	-0,9	+2,2	+1,8	+2,4	-5,1	+26,1	-4,5	+2,4	-2,6	23,1	-13,4	+27,9	+19,0
2022	+7,1	+5,4	-0,5	+5,9	+2,4	+2,8	-1,0	+3,3					10,4	-3,4	-16,2	+28,1

Evolución Acumulada



Diferencial Acumulado



Estrategia de Inversión

PERFIL INVERSOR

Destinado a inversores que además de rentabilidad positiva, busquen diversificar con un producto cuyo mejor escenario se produce en momentos de aumento de volatilidad y caídas en la renta variable.

OBJETIVO

Obtener rendimientos positivos en años alcistas del S&P 500 y superar la inversa de las caídas en años bajistas.

ESTRATEGIA

Combinación de estrategias de generación de ingresos constantes en mercados laterales o poco alcistas junto con estrategias de cobertura de riesgo de cola.

INSTRUMENTOS UTILIZADOS

Posición neta alcista en volatilidad y corta en índices a través de opciones y futuros.

HEDGE

Long VIX
Short S&P 500

COBERTURA DE RIESGO DE COLA		COBERTURA DE CORRECCIONES	
VIX STRUCTURE ARBITRAGE	TAIL RISK HEDGE	CORRECTION HEDGE	VIX EXTREMES ARBITRAGE
Opciones Futuros VIX	Opciones Futuros S&P 500	Opciones Futuros S&P 500	Opciones Futuros VIX