**Ficha técnica: Portafolio de acciones Fecha de inversión: 2024-03-05 Fecha de análisis: 2024-12-02**

**Retorno Acumulado del portafolio frente al Benchmark   
Benchamark:** S&P 500

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | Acumulado | Ultimo mes | Ultimo año | Ultimos 5 años |
| Retorno anualizado | 20.16% | 0.89% | 34.34% | 18.2% |
| Volatilidad anualizada | 16.9% | 19.43% | 16.12% | 25.67% |
| Retorno del benchmark | 13.66% | 0.42% | 31.57% | 14.11% |

|  |  |
| --- | --- |
| **Descripción de la estrategía:** El portafolio se encuentra compuesto en su mayoría por renta variable, en conjunto con instrumentos para seguir el comportamiento de otras materias primas. El portafolio es de alto riesgo, al incluir en su mayoría instrumentos de renta variable. El portafolio posee una exposición a múltiples monedas, al igual que posee activos de renta variable de múltiples países y de múltiples sectores.  **Sharpe ratio: 2.77(1)  Numero de activos: 8  VaR(95% 1-año): -0.32% (2)**  (1): Rendimiento ajusto por riesgo   (2): Posibilidad de perdidad en un año |  |

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |

|  |  |
| --- | --- |
| Acción | Participación |
| Apple Inc. AAPL | 10.0% |
| Pfizer Inc. PFE | 5.0% |
| JPMorgan Chase & Co. JPM | 20.0% |
| The Home Depot, Inc. HD | 15.0% |
| Exxon Mobil Corporation XOM | 15.0% |
| Tesla, Inc. TSLA | 15.0% |
| AstraZeneca PLC AZN | 10.0% |
| Banco Santander, S.A. SAN | 10.0% |
| Total | 100% |