

Informe ejecutivo

Analisis IBEX 2025

Resumen Ejecutivo

El análisis de las metricas del IBEX 35 para el año 2025 muestra una variedad de rendimientos y volatilidades entre las empresas. Las 5 empresas con mayor rentabilidad son IDR.MC, SAN.MC, UNI.MC, BBVA.MC y MAP.MC, mientras que las 5 con menor rentabilidad son PUIG.MC, TEF.MC, CLNX.MC, RED.MC y AMS.MC.

Empresas con Mayor Rentabilidad

Las empresas con mayor rentabilidad presentan un comportamiento estable y consistente en sus rendimientos. Por ejemplo:

- IDR.MC presenta una rentabilidad del 181,162791% y una volatilidad del 39,712650%, lo que indica una estabilidad en sus resultados.
- SAN.MC tiene una rentabilidad del 126,436521% y una volatilidad del 31,857717%, lo que sugiere una consistencia en sus rendimientos.
- UNI.MC presenta una rentabilidad del 120,190779% y una volatilidad del 28,776322%, lo que indica un rendimiento estable.

Empresas con Menor Rentabilidad

Por otro lado, las empresas con menor rentabilidad presentan un comportamiento más volátil y menos consistente en sus rendimientos. Por ejemplo:

- PUIG.MC tiene una rentabilidad del -18,097321% y una volatilidad del 30,398946%, lo que sugiere un rendimiento muy volátil.
- TEF.MC presenta una rentabilidad del -14,328657% y una volatilidad del 24,559002%, lo que indica un comportamiento menos estable.

Limitaciones

Es importante destacar que este análisis se basa en las metricas proporcionadas y no realiza cálculos nuevos ni ajustes a estas. Además, es importante tener en cuenta que la rentabilidad y la volatilidad pueden variar dependiendo de factores externos y internos de cada empresa.

Hechos de Interpretación

- La mayoría de las empresas con mayor rentabilidad tienen un sector específico (Industriales o Banca) y una puntuación de 7, lo que sugiere una estabilidad en sus resultados.
- Las empresas con menor rentabilidad tienen un sector más diverso y una puntuación más baja, lo que puede indicar un comportamiento menos estable.

Comparativa por sectores

Comparativa Interna de las Empresas del IBEX 35

Grupos por Sector:

- **Banca:** SAN.MC, UNI.MC, BBVA.MC, CABK.MC, BKT.MC, SAB.MC
- **Utilities:** ELE.MC, IBE.MC, ENG.MC, NTGY.MC, LOG.MC, REP.MC
- **Industriales:** IDR.MC, MAP.MC, ACS.MC, ANA.MC, FER.MC, AENA.MC, SLR.MC, MRL.MC, SCYR.MC, MTS.MC, ACX.MC, ANE.MC, ITX.MC, GRF.MC, IAG.MC, COL.MC, FDR.MC, ROVI.MC, AMS.MC, CLNX.MC, TEF.MC, PUIG.MC

Comparativa de los Grupos por Criterios:

Sector	Rentabilidad (2025)	Volatilidad (2025)	Drawdown (2025)
Banca	114.419411	29.349111	-21.236658
Utilities	34.394191	18.341911	-10.206897
Industriales	54.511151	28.351311	-24.322034

Perfiles de Riesgo Relativos:

- **Bajo:** Utilities (ELE.MC, IBE.MC, ENG.MC, NTGY.MC, LOG.MC, REP.MC)
- **Medio:** Banca (SAN.MC, UNI.MC, BBVA.MC, CABK.MC, BKT.MC, SAB.MC) y Industriales (ACS.MC, ANA.MC, FER.MC, AENA.MC, SLR.MC, MRL.MC, SCYR.MC, MTS.MC, ACX.MC, ANE.MC, ITX.MC, GRF.MC, IAG.MC)
- **Alto:** Industriales (COL.MC, FDR.MC, ROVI.MC, AMS.MC, CLNX.MC, TEF.MC, PUIG.MC)

Limitación del Análisis:

El análisis se basa únicamente en los datos proporcionados por la tabla de métricas 2025 del IBEX 35 y no considera otros factores que podrían influir en el rendimiento de las empresas, como la economía general, la política monetaria o los eventos geopolíticos.

Sugerencia de cartera

Propuesta Preliminar de Inversión

Tabla Seleccin (5 filas)

Ticker	Sector	Return_Pct	Vol_Pct	Max_Drawdown_Pct	Score
IDR.MC	Industriales	181.162791	39.712650	-16.632757	7
MAP.MC	Industriales	74.172720	23.613943	-11.187371	7
ELE.MC	Utilities	46.666667	19.519233	-9.662215	7
ACS.MC	Industriales	73.904138	27.442654	-16.699552	6
FER.MC	Industriales	37.885463	20.121568	-14.600551	6

Tabla Pesos (6 filas)

Ticker	Peso (%)
IDR.MC	20.0%
MAP.MC	20.0%
ELE.MC	20.0%
ACS.MC	20.0%
FER.MC	20.0%
TOTAL	100.0%

Justificación

La propuesta selecciona tickers que equilibran rentabilidad y riesgo, con diversificación sectorial. Los 5 tickers seleccionados son:

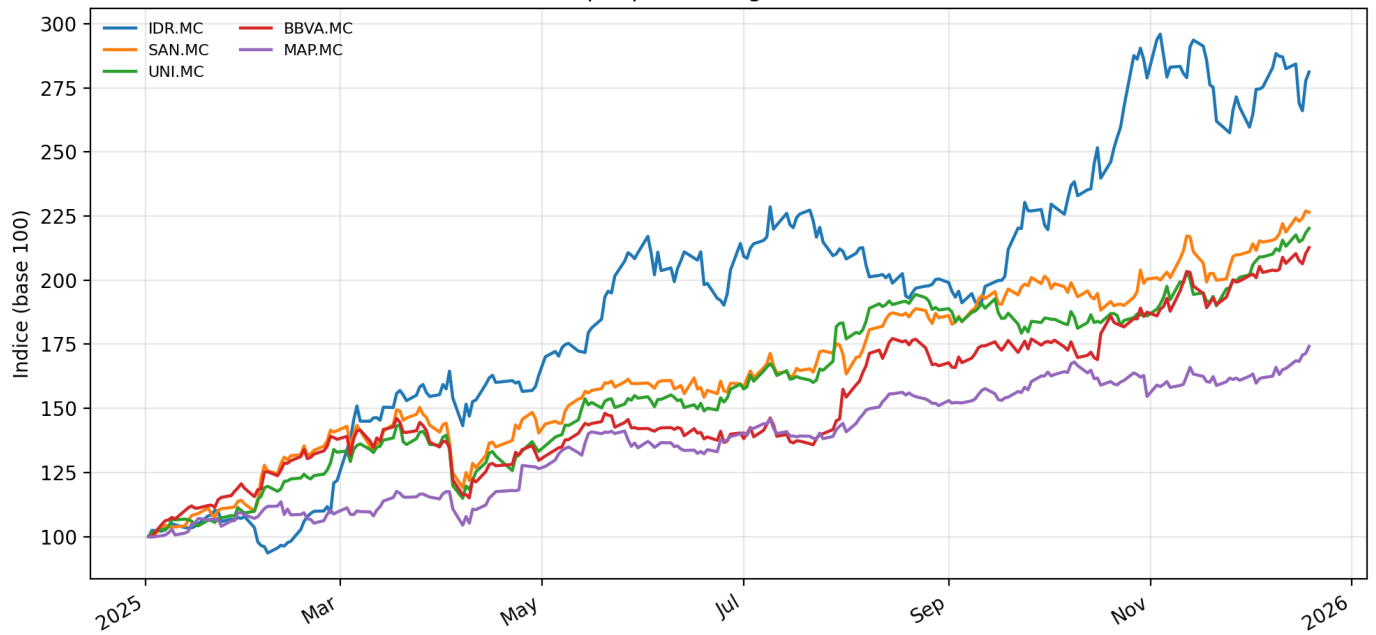
- IDR.MC (Industriales): una de las empresas más rentables del sector, con un retorno del 181,16% en 2025.
- MAP.MC (Industriales): otra empresa rentable del sector, con un retorno del 74,17% en 2025.
- ELE.MC (Utilities): una empresa con un retorno moderado y baja volatilidad, lo que la hace más segura.
- ACS.MC (Industriales): una empresa con un retorno moderado y una volatilidad media, lo que la hace una buena opción para diversificar el portafolio.
- FER.MC (Industriales): una empresa con un retorno bajo y alta volatilidad, lo que la hace una buena opción para equilibrar el riesgo.

La tabla de pesos muestra que cada ticker tiene un peso del 20% en el portafolio, lo que significa que si el portafolio tiene un valor de 100 euros, IDR.MC tendrá un valor de 40 euros, MAP.MC tendrá un valor de 20 euros, etc. Esto garantiza una diversificación sectorial y equilibra la rentabilidad y el riesgo en el portafolio.

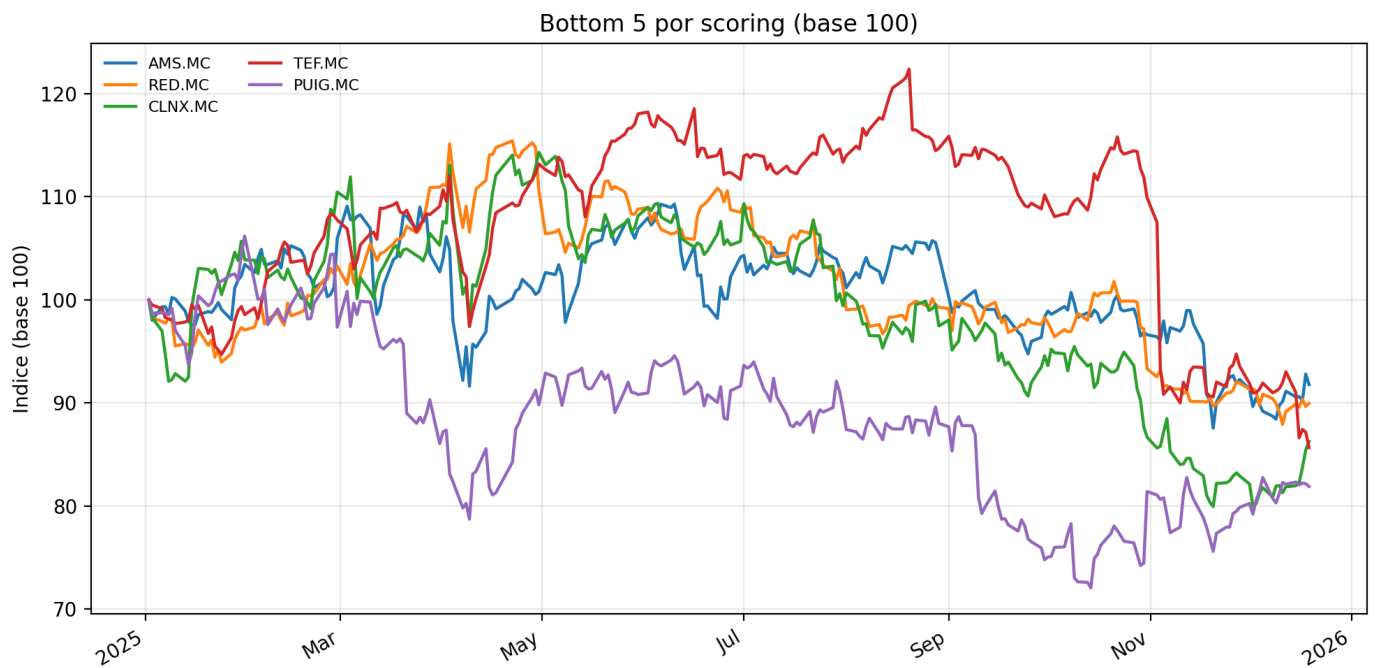
Graficas deterministas

Top 5 por scoring (base 100)

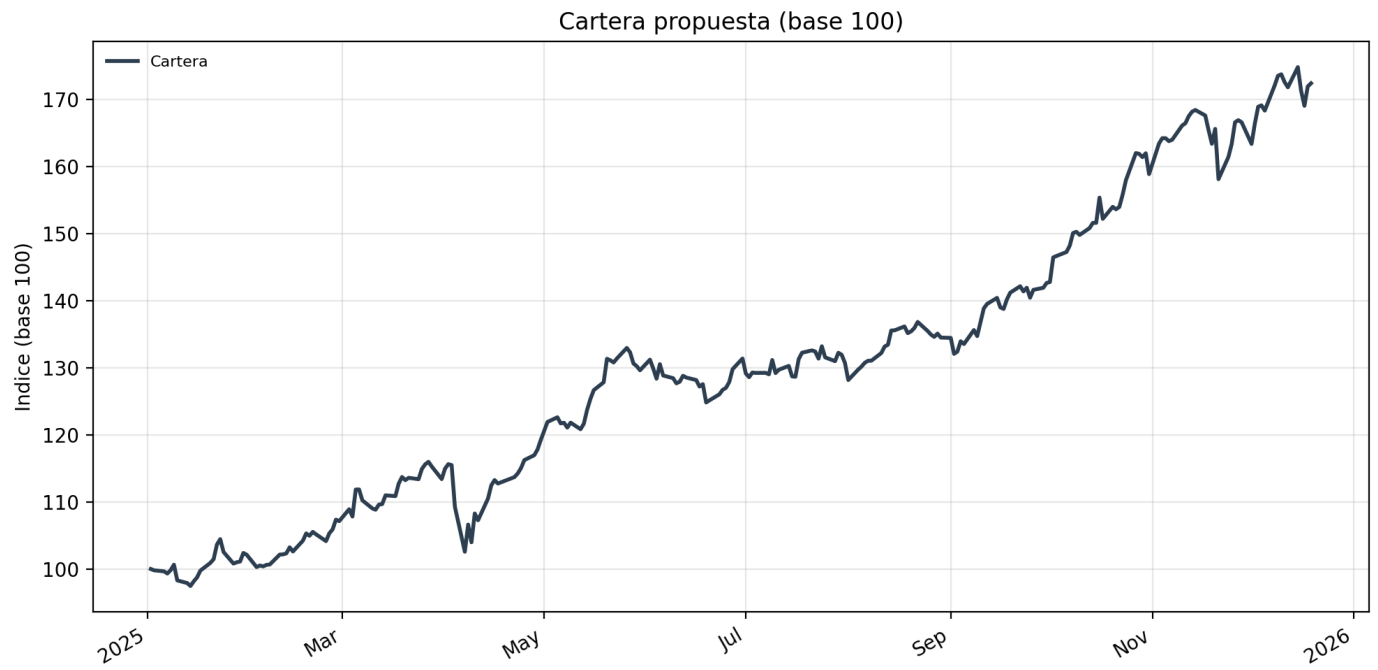
Top 5 por scoring (base 100)



Bottom 5 por scoring (base 100)



Cartera propuesta (base 100)



Top 10

ticker	rank	score	return_pct	vol_pct	max_drawdown_pct	sector
IDR.MC	1	7	181.16	39.71	-16.63	Industriales
SAN.MC	2	7	126.44	31.86	-20.79	Banca
UNI.MC	3	7	120.19	28.78	-19.93	Banca
BBVA.MC	4	7	112.68	30.08	-21.24	Banca
MAP.MC	5	7	74.17	23.61	-11.19	Industriales
ELE.MC	6	7	46.67	19.52	-9.66	Utilities
IBE.MC	7	7	34.09	17.17	-9.92	Utilities
CABK.MC	8	6	100.19	28.37	-20.40	Banca
BKT.MC	9	6	88.36	26.90	-21.59	Banca
SAB.MC	10	6	83.77	31.50	-22.34	Banca