

APMT Global Multiestrategia F (Fondos)

Algoritmos de Predicción de Mercados y Trading

Fecha actualización 01/07/2026
Divisa: EUR

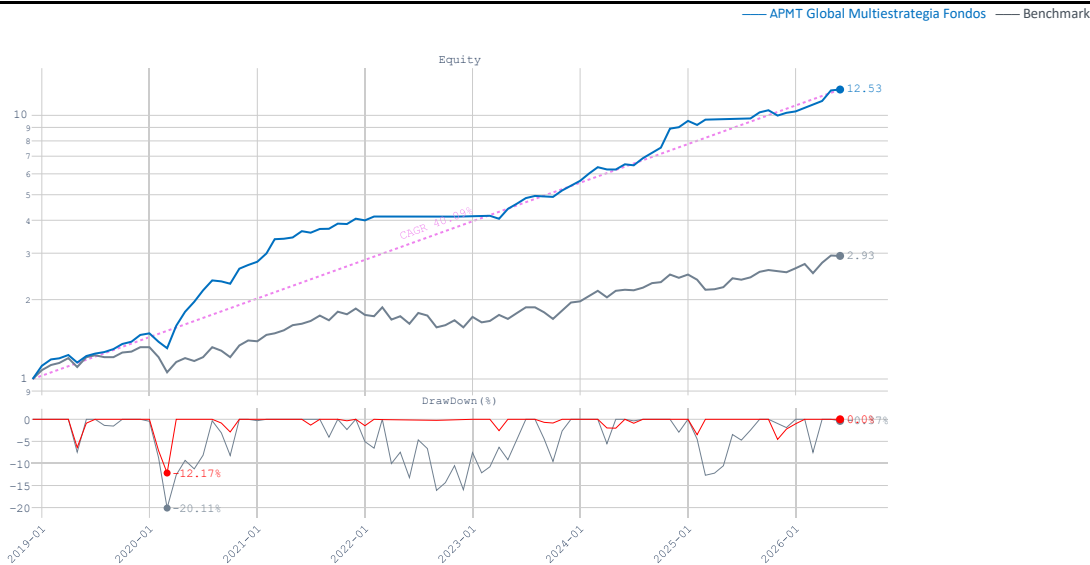
Política de inversión

Cartera con exposición flexible en Renta Variable de 0% a 100%, distribuida en un máximo de diez posiciones en fondos de inversión, con rotación mensual por fuerza relativa y/o estacionalidad.

La selección y ponderación de las posiciones en cartera se realiza mediante sistemas algorítmicos. Cada sistema, que tiene un tipo de estrategia (global, geográfica o sectorial) y estilo de inversión (crecimiento, valor o equilibrado), determinará cada uno de los componentes de la cartera.

Como medida de protección de capital, la cartera puede llegar a estar posicionada un 100% en fondos monetarios. No se utiliza apalancamiento ni productos derivados.

Gráfico de evolución



Calendario de rentabilidades

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2019	12,18%	5,77%	0,94%	2,93%	-6,38%	5,87%	2,15%	1,35%	2,63%	4,57%	1,98%	6,10%	46,92%
2020	1,39%	-7,10%	-5,46%	21,68%	13,00%	9,12%	10,51%	9,06%	-0,85%	-2,03%	14,05%	3,26%	84,18%
2021	2,89%	7,52%	13,25%	0,40%	1,13%	5,63%	-1,31%	3,32%	0,16%	4,58%	-0,34%	4,77%	49,87%
2022	-1,45%	3,40%	-0,07%	-0,04%	-0,05%	-0,05%	-0,04%	0,00%	0,02%	0,06%	0,12%	0,13%	1,97%
2023	0,18%	0,18%	0,22%	-2,57%	9,02%	4,71%	4,95%	1,90%	-0,69%	-0,16%	5,78%	4,18%	30,74%
2024	4,41%	6,72%	5,56%	-1,96%	-0,05%	4,66%	-0,89%	6,42%	5,04%	4,40%	18,08%	1,21%	66,75%
2025	5,71%	-3,48%	4,72%	0,19%	0,20%	0,19%	0,31%	0,17%	5,47%	1,85%	-4,55%	2,44%	13,42%
2026	1,22%	3,35%	2,96%	2,95%	9,67%	0,77%	-	-	-	-	-	-	22,55%

Comentario del mes

La cartera APMT Global Multiestrategia F (Fondos) obtiene una rentabilidad de un **+0,77%** en euros en el mes de junio.

Durante el mes destaca la revalorización de Janus Henderson Glb Tech&Inno A2 EURHdg (+4,80%) y JPM US Technology A (acc) EUR (+4,33%). El peor comportamiento en el mes es para JPM Europe Dynamic Technologies A (acc) EUR (-1,54%) y MS INVF US Growth A EURHdg (-1,26%).

En lo que llevamos de año, el MSCI World* se revaloriza un +15,14% en euros, mientras que la cartera se revaloriza un **+22,55%**, por lo que mantenemos un diferencial sobre el benchmark de +7,41%.

Rentabilidades

Comparativa entre la cartera y su referencia (benchmark) en diversos periodos.

Periodo	Cartera APMT	Benchmark	Diferencia
2026 (año en curso)	22,55%	15,14%	7,41%
1 mes	0,77%	-0,37%	1,14%
3 meses	13,78%	16,03%	-2,25%
6 meses	22,55%	15,14%	7,41%
1 año	29,35%	21,46%	7,89%
3 años (anualizado)	39,40%	17,94%	21,45%
5 años (anualizado)	28,08%	21,69%	6,39%
Desde 2019-01 (anualizado)	40,09%	15,39%	24,70%

*Benchmark: iShares MSCI World ETF [URTH] (Total Return & EUR adjusted)

Datos Estadísticos

Periodo estadístico: 5 años. Benchmark: iShares MSCI World ETF [URTH] (Total Return & EUR adjusted)

Ratios rentabilidad-riesgo

Métrica	Cartera APMT	Benchmark
Ratio Sharpe	2,05	0,76
Ratio Sortino	8,26	1,21
Ratio Calmar	6,17	0,78

Estadísticas mensuales

Métrica	Cartera APMT	Benchmark
Rentabilidad mejor mes	18,08%	10,00%
Rentabilidad peor mes	-4,55%	-10,14%
Ganancia media	3,40%	4,46%
Pérdida media	-1,04%	-4,27%
Meses Positivos	71,67%	61,67%
Meses Negativos	28,33%	38,33%
Esperanza matemática	2,14%	1,11%
Profit Factor	8,26	1,68

Análisis frente al mercado

Métrica	Cartera APMT
Alpha	22,56%
Beta	0,24
Correlación	0,34
R-Cuadrado	11,23%
Ratio Treynor	0,09
Tracking error	17,94%

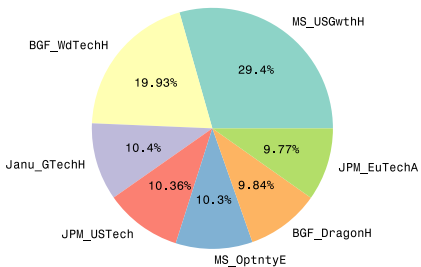
Indicadores de Riesgo y caídas

Métrica	Cartera APMT	Benchmark
Volatilidad (anualizada)	12,53%	17,70%
Downside Risk (anualizado)	3,12%	11,02%
Máxima caída (drawdown)	-4,55%	-16,10%
Tiempo de recuperación (mes)	3	10
Underwater duration (mes)	9	15

Posiciones de la cartera

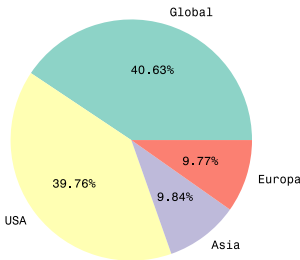
Alias	Nombre	Rdto.Mes	Exposición
Janu_GTechH	Janus Henderson Glb Tech&Inno A2 EURHdg	4,80%	10,40%
JPM_USTech	JPM US Technology A (acc) EUR	4,33%	10,36%
MS_OptntyE	MS INV Global Opportunity A EUR	3,77%	10,30%
BGF_WdTechH	BGF World Technology A2 EURHdg	0,38%	19,93%
BGF_DragonH	BGF Asian Dragon A2 EURHdg	-0,85%	9,84%
MS_USGwthH	MS INV US Growth A EURHdg	-1,26%	29,40%
JPM_EuTechA	JPM Europe Dynamic Technologies A (acc) EUR	-1,54%	9,77%
Cartera		0,77%	100,00%

Exposición por Activo [2026-06-30]



Exposición geográfica

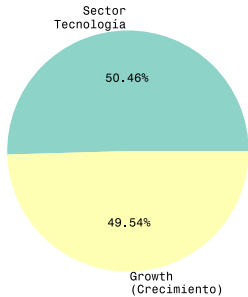
Exposición Geográfica [2026-06-30]



Zona	Rdto.Mes	Exposición
Global	2,33%	40,63%
USA	0,14%	39,76%
Asia	-0,85%	9,84%
Europa	-1,54%	9,77%
Cartera	0,77%	100,00%

Exposición por estrategia

Exposición por Estrategia [2026-06-30]



Estrategia	Rdto.Mes	Exposición
Sector Tecnología	1,67%	50,46%
Growth (Crecimiento)	-0,17%	49,54%
Cartera	0,77%	100,00%

La información contenida en este informe es con fines únicamente informativos, basándose en datos públicos disponibles y recopilados de fuentes consideradas fiables. No se asume responsabilidad alguna por la precisión o integridad de los datos e información facilitados. Este documento no constituye, en ningún caso, una recomendación de inversión, ni una oferta de venta o solicitud de compra de instrumentos financieros, ni una oferta de servicios de gestión o asesoramiento financiero. Invertir en base a esta información, puede no proporcionar resultados positivos a un inversor no profesional. Rendimientos pasados no son indicativos de rendimientos futuros. El desarrollador del software podría mantener, en algún momento, posiciones abiertas en uno o varios de los activos mencionados en este documento.