

Carteras modelo

Activos en carteras

ISIN	Fondo	Categoría	Rentabilidad anualizada 3 años	Volatilidad
ES0116831050	Gestión Boutique gCapital Total Market FI	Mixtos Moderados EUR - Global	6,87%	6,24%
LU1481583711	Flossbach von Storch - Bond Opportunities RT	RF Flexible Global-EUR Cubierto	5,03%	5,09%
LU0034353002	DWS Floating Rate Notes LC	RF Ultra Corto Plazo EUR	3,74%	0,47%
FR0010149120	Carmignac Sécurité A EUR Acc	RF Diversificada Corto Plazo EUR	4,57%	1,88%
LU1694212348	Nordea 1 - Low Duration European Covered Bond Fund BP EUR	RF Deuda Corporativa Corto Plazo EUR	3,34%	1,15%
IE00B2NXXW18	Seilern World Growth EUR U R	RV Global Cap. Grande Growth	6,45%	13,67%
LU0690374615	Fundsmith Equity Fund R EUR Acc	RV Global Cap. Grande Growth	6,69%	11,50%
LU0187079347	Robeco Global Consumer Trends D EUR	RV Global Cap. Grande Growth	13,44%	13,43%
LU1213836080	Fidelity Global Technology Fund A-Acc-EUR	RV Sector Tecnología	20,52%	16,08%

Pesos de las carteras

Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
ES0116831050	30,00%	60,00%	60,00%	60,00%	30,00%
LU1481583711	22,00%	14,00%	10,00%	-	-
LU0034353002	18,00%	12,00%	10,00%	-	-
FR0010149120	16,00%	8,00%	-	-	-
LU1694212348	14,00%	6,00%	-	-	-
IE00B2NXXW18	-	-	10,00%	14,00%	22,00%
LU0690374615	-	-	10,00%	12,00%	18,00%
LU0187079347	-	-	-	8,00%	16,00%
LU1213836080	-	-	-	6,00%	14,00%
Volatilidad objetivo	<5%	5%-7,5%	7,5%-10%	10%-15%	>15%

Rentabilidad acumulada

Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
3 meses	1,79%	2,73%	2,26%	2,60%	2,03%
6 meses	3,15%	4,48%	3,71%	4,51%	4,05%
1 año	3,70%	4,61%	2,47%	2,69%	1,35%
3 años anualizado	5,14%	5,93%	6,40%	8,22%	9,80%
5 años anualizado	2,43%	3,45%	4,35%	5,84%	6,96%
Año	3,03%	3,34%	0,82%	-0,04%	-2,04%

Distribución de activos

Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
Acciones	16,09%	32,18%	51,93%	71,49%	84,82%
Obligaciones	72,17%	59,14%	42,31%	24,88%	12,46%
Efectivo	10,38%	6,91%	4,14%	2,23%	1,91%
Otro	1,35%	1,76%	1,62%	1,40%	0,82%
No clasificado	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

Asignación geográfica

Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
Europa	16,90%	16,90%	21,27%	21,66%	23,25%
América	66,46%	66,46%	68,42%	68,07%	68,38%
Asia	16,42%	16,42%	10,17%	10,18%	8,33%

Sectores RV

Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
Cíclico	32,75%	32,75%	25,73%	24,28%	20,55%
Sensible al ciclo	52,10%	52,10%	46,48%	49,07%	49,76%
Defensivo	14,91%	14,91%	27,28%	26,55%	29,64%

Estilo RF

Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
Duración efectiva	3,65	3,95	4,37	4,16	4,16
Vencimiento efectivo	5,41	5,59	5,93	5,68	5,68
Calidad crediticia media	BBB	BBB	BB	BB	BB

Peores rentabilidades por período					
Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
3 meses	-5,27%	-7,15%	-8,90%	-10,28%	-12,04%
6 meses	-7,18%	-8,80%	-12,00%	-15,60%	-19,14%
1 año	-7,47%	-9,28%	-12,67%	-16,72%	-20,21%
3 años anualizado	-0,57%	-2,29%	-0,70%	0,73%	2,10%
5 años anualizado	0,50%	1,15%	3,36%	5,48%	6,74%
Mejores rentabilidades por período					
Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
3 meses	5,59%	6,67%	9,84%	13,31%	16,57%
6 meses	6,96%	8,34%	11,62%	15,98%	21,71%
1 año	10,80%	15,39%	21,59%	30,68%	39,53%
3 años anualizado	5,14%	7,52%	12,34%	17,74%	23,59%
5 años anualizado	3,17%	4,17%	7,04%	11,05%	16,19%
Estadísticas de rentabilidad y riesgo 3 años					
Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
Volatilidad	2,84%	4,24%	6,17%	8,32%	10,32%
Media aritmética	5,06%	5,86%	6,41%	8,26%	9,91%
Ratio de Sharpe	0,75	0,69	0,56	0,64	0,68
Estadísticas de rentabilidad y riesgo 5 años					
Cartera	Conservadora	Moderada	Equilibrada	Dinámica	Muy dinámica
Volatilidad	3,51%	5,07%	7,43%	9,99%	12,38%
Media aritmética	2,46%	3,52%	4,54%	6,19%	7,50%
Ratio de Sharpe	0,27	0,39	0,40	0,46	0,48

Composición de la cartera Core
Gestión Boutique
gCapital Total Market

Activo	Peso	Categoría	Cambio
Efectivo y repos	5,36%	Mercado Monetario EUR	
Amundi Russell 1000 Growth UCITS ETF Acc	11,83%	RV USA Cap. Grande Growth	
iShares Edge MSCI USA Momentum Factor UCITS ETF	11,12%	RV USA Cap. Grande Blend	
Xtrackers MSCI USA UCITS ETF 1C	10,89%	RV USA Cap. Grande Blend	
JPMorgan Active Global Aggregate Bond UCITS ETF EUR Hedged (acc)	6,12%	RF Diversificada Global - Cubierto EUR	
Xtrackers II EUR Corporate Bond Short Duration SRI PAB UCITS ETF 1C	5,09%	RF Deuda Corporativa EUR	
iShares Edge MSCI Europe Momentum Factor UCITS ETF	4,88%	RV Europa Cap. Grande Blend	
UBS ETF (LU) J.P. Morgan USD EM Diversified Bond 1-5 UCITS ETF (hedged to EUR) A-acc	3,62%	RF Global Emergente - Sesgo EUR	
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF EUR Hedged (Dist)	3,57%	RF Bonos Alto Rendimiento Global - EUR Cubierto	
Xtrackers iBoxx EUR Corporate Bond Yield Plus UCITS ETF 1D	3,57%	RF Deuda Corporativa EUR	
UBS ETF (LU) Bloomberg US Liquid Corporates 1-5 Year UCITS ETF (hedged to EUR) A-acc	3,33%	RF Otros	
iShares Edge MSCI Europe Value Factor UCITS ETF	3,23%	RV Europa Cap. Grande Value	
iShares Core Euro Corporate Bond UCITS ETF	3,16%	RF Deuda Corporativa EUR	
iShares Core MSCI Emerging Markets IMI UCITS ETF	3,15%	RV Global Emergente	
iShares Edge MSCI EM Value Factor UCITS ETF USD(Acc)	2,90%	RV Global Emergente	
UBS ETF (LU) Sustainable Development Bank Bonds UCITS ETF (hedged to EUR) A-acc	2,59%	RF Otros	
iShares MSCI Japan SRI UCITS ETF	2,56%	RV Japón Cap. Grande	
PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF Acc	2,46%	RF Ultra Corto Plazo EUR	
Xtrackers Barclays Global Aggregate Bond Swap UCITS ETF 5C EUR hedged	2,31%	RF Global - EUR Cubierto	
Xtrackers iBoxx Sovereigns Eurozone Yield Plus UCITS ETF 1C	2,22%	RF Deuda Pública EUR	
iShares Euro Corporate Bond Financials UCITS ETF	1,98%	RF Deuda Corporativa EUR	
Xtrackers MSCI Canada ESG Screened UCITS ETF 1C	1,83%	RV Canadá	
iShares Core MSCI Pacific Ex Japan UCITS ETF	1,53%	RV Pacífico (ex-Japón)	
iShares MSCI Europe UCITS ETF	0,70%	RV Europa Cap. Grande Blend	

nuevo
incremento
disminución

Distribución de activos		Rentabilidad acumulada	
Acciones	54,61%	3 meses	3,93%
Obligaciones	40,02%	6 meses	6,14%
Efectivo	5,36%	1 año	5,80%
Otro	0,00%	3 años anualizado	6,88%
No clasificado	0,00%	5 años anualizado	4,76%
		Año	3,65%

Asignación geográfica		Sectores RV		Estilo RF	
Europa	16,90%	Cíclico	32,75%	Duración efectiva	4,16
América	66,46%	Sensible al ciclo	52,10%	Vencimiento efectivo	5,68
Asia	16,42%	Defensivo	14,91%	Calidad crediticia media	BB

Rentabilidad por períodos			Estadísticas de rentabilidad y riesgo		
	Mejor período	Peor período		3 años	5 años
3 meses	9,10%	-9,61%			
6 meses	12,74%	-10,84%	Volatilidad	6,24%	7,27%
1 año	21,32%	-12,30%	Media aritmética	6,87%	4,92%
3 años anualizado	10,67%	-4,54%	Ratio de Sharpe	0,63	0,47
5 años anualizado	5,38%	0,78%			

Invertir en la carteras gCapital WM

Para invertir en la carteras de gCapital WM es necesario abrir una cuenta en myinvestor (myinvestor.es) o en Andbank España (andbank.es) para suscribir los fondos de inversión mencionados. Para cualquier duda, puede contactar con nosotros en info@gcapital.es (el inversor contrata directamente con la entidad comercializadora, gCapital WM EAF solamente le puede informar de la operativa de contratación).

Aviso importante

Este informe no constituye asesoramiento en materia de inversión. Este informe es una recomendación de carácter general y por lo tanto no personalizado. El informe se divulga exclusivamente al público, por lo que no se considera una recomendación personalizada. Para un asesoramiento personalizado atendiendo a sus circunstancias personales, por favor contacte con una empresa de servicios de inversión registrada y debidamente autorizada por la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) para realizar asesoramiento en materia de inversión como gCapital Wealth Management EAF.

La información suministrada en este documento representa la opinión de gCapital WM EAF y, a pesar de que está basada en criterios objetivos y que se han obtenido de fuentes consideradas fiables, no garantizamos su exactitud y no debería basarse únicamente en la misma para tomar su decisión de inversión. Este análisis queda expresada en la fecha de emisión del documento, sujeta a los cambios posteriores que experimenten los mercados. gCapital WM EAF no se responsabiliza de la toma de decisiones que se fundamenten en esta información.

Fuentes: Departamento de Analítica de Carteras y Riesgos de gCapital WM EAF.

Copyright © 2023 gCapital Wealth Mangement EAF. Queda prohibida la reproducción, duplicación, redistribución y/o comercialización, total o parcial de los contenidos de este documento, ni aun citando las fuentes, salvo consentimiento previo por escrito de gCapital WM EAF.