

SMART INVESTOR

Descripción

Smart Investor es una estrategia de inversión sistemática. El proceso de inversión utiliza modelos matemáticos y algoritmos propios, con nula influencia humana en el posicionamiento de la cartera. Los sistemas empleados actúan en activos que muestran procesos estadísticamente robustos de *momentum*. Se enfoca en la negociación de corto plazo de activos líquidos en el mercado de FX y *commodities*. La asignación de capital entre activos se realiza usando optimización cuantitativa teniendo en cuenta los procesos estadísticos y la volatilidad inherente de cada activo.

Desempeño mensual¹

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Set	Oct	Nov	Dic	Anual
2021	-0.9%	6.5%	0.6%	3.0%	-0.4%	6.9%	-0.8%	-4.7%	-	-	-	-	10.0%
2020	5.8%	1.2%	-0.6%	-0.4%	6.3%	0.1%	-0.5%	-1.9%	-2.3%	0.5%	1.6%	-0.2%	9.6%
2019	-1.4%	4.4%	2.2%	-1.4%	-1.6%	0.7%	0.8%	1.2%	9.3%	3.7%	1.7%	1.7%	23.0%
2018	3.0%	0.9%	5.1%	1.0%	-0.4%	5.4%	-2.3%	-1.9%	-5.7%	-0.6%	-0.1%	-0.2%	3.5%
2017	-	-	-	-	26.8%	1.1%	3.7%	0.1%	7.2%	2.9%	-2.4%	2.9%	47.3%

Crecimiento



Información

AUM ²	\$2,581,214
Rentabilidad acumulada ³	121.1%
Rentabilidad mensual	1.6%
Caída máxima ⁴	-13.7%
Tasa de éxito	62%
Rentabilidad diaria	0.05%
Operaciones por mes	57
Duración prom. por operación	6h
Inicio	16/05/2017
Última actualización	31/08/2021
Instrumentos ⁵	FX (Spot), Gold (Spot)

Notas:

1. Los rendimientos pasados no son indicativos de resultados futuros. Las cifras ofrecidas de rendimiento y de gestión de riesgo están basadas en datos históricos y no son necesariamente predicciones de resultados futuros.
2. *Assets Under Management*. Fondos invertidos bajo la estrategia.
3. Rendimiento histórico acumulado desde el inicio de operaciones.
4. Máxima pérdida histórica de la estrategia.
5. Instrumentos financieros que se negocian con la estrategia.

Sobre EQUANT

EQUANT es una firma de gestión de inversiones fundada en el año 2012, especializada en el desarrollo y aplicación de estrategias de inversión sistemáticas basadas en análisis cuantitativo, las cuales tienen como objetivo facilitar la toma de decisiones de inversión, controlar eficientemente la exposición al riesgo, maximizar el rendimiento del capital y demostrar consistencia en el tiempo. EQUANT es la primera firma de gestión cuantitativa de inversiones del Perú y tiene como misión poner al alcance de sus inversionistas herramientas de inversión tradicionalmente reservadas al ámbito institucional.

ADVERTENCIA DE RIESGO: La negociación en los mercados financieros conlleva un alto nivel de riesgo y podría no ser apropiada para todo tipo de inversionistas. El alto grado de apalancamiento, así como la volatilidad del mercado, puede jugar tanto a su favor como en su contra. Por lo tanto, antes de negociar en dichos mercados, usted debe considerar cuidadosamente sus objetivos de inversión, nivel de experiencia y tolerancia al riesgo. **Le recordamos que existe la posibilidad de perder una parte o toda la inversión inicial, por lo que no debe invertir dinero que no pueda permitirse perder.** Debe tener conocimiento previo de todos los riesgos asociados a la negociación y, en caso tuviese alguna duda, buscar la ayuda de un asesor financiero independiente.