

Ambos son fondos de **Retorno Absoluto**, cada uno con sus peculiaridades, pero que sus principales objetivos son la **obtención de rentabilidad** con independencia del comportamiento de los mercados financieros, por un lado, y la **protección y optimización** del patrimonio por el otro.

Desde **GVC Gaesco Gestión** aplicamos un enfoque cuantitativo para detectar y aprovechar las ineficiencias de los mercados, con carácter universal, buscando una tipología de ineficiencias que tengan perdurabilidad en el tiempo. Se trata, además, de aprovechar los ciclos internos de los mercados bursátiles.

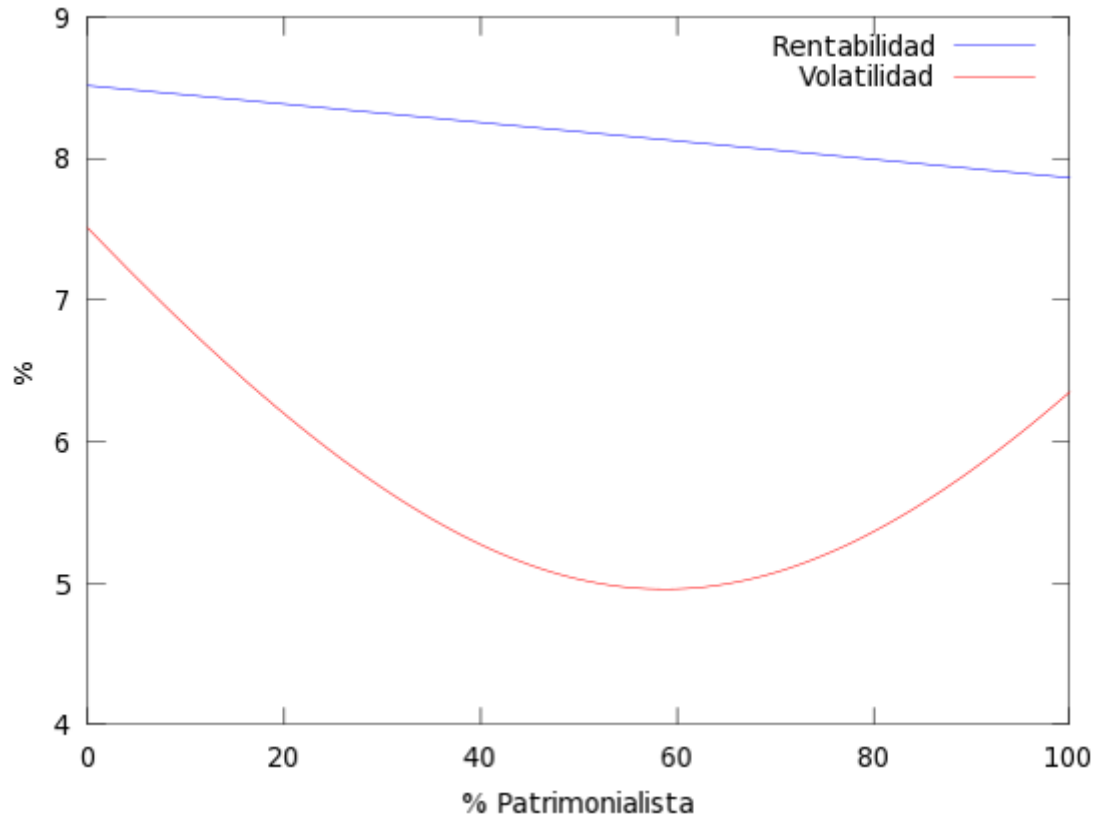
Se aplican técnicas propias desarrolladas íntegramente por GVC Gaesco Gestión (*equipo interno*), con la colaboración de un equipo de I+D de la Facultad de Física de la Universidad de Barcelona (*equipo externo*).

De las 19 técnicas y 63 estrategias que se han desarrollado, validado y optimizado, el fondo **GVC Gaesco Patrimonialista** se centra en una de ellas, mientras que el fondo **GVC Gaesco Retorno Absoluto** aplica una combinación de ellas. Aunque el perfil del primero es más conservador, combinándolos se consigue potenciar las fortalezas de cada uno de ellos.

Una inversión del **50% en GVC Gaesco Retorno Absoluto y 50% en GVC Gaesco Patrimonialista** consigue disminuir considerablemente la volatilidad y, consecuentemente, incrementar el ratio de sharpe.

En la tabla adjunta se analizan 4 ratios importantes para los fondos de Retorno Absoluto:

	100% GVC Gaesco Retorno Absoluto	100% GVC Gaesco Patrimonialista	50%/50%
Rentabilidad anualizada	8.52%	7.87%	<b>8.19%</b>
Volatilidad	7.51%	6.35%	<b>5.03%</b>
Ratio de Sharpe	1.13%	1.24%	<b>1.63%</b>
ML 99% 1 year	6.08%	5.69%	<b>5.61%</b>



Síguenos: