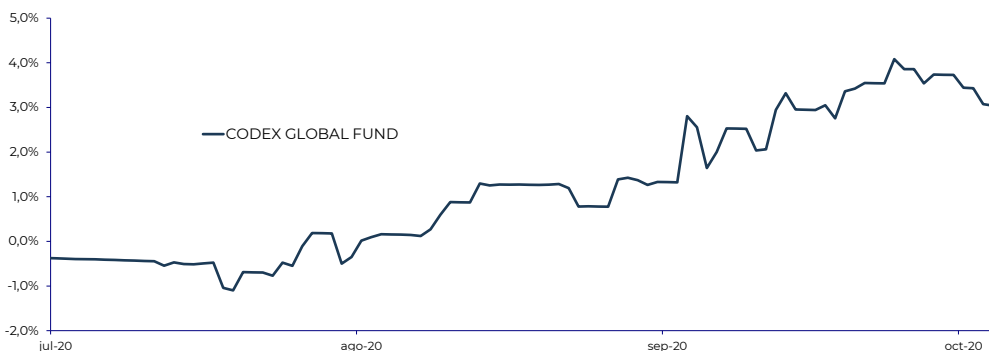


DATOS FUNDAMENTALES

ISIN: ES0119251009  
NIF: V88644323  
Nº de Registro: 5461  
Patrimonio: 5.548.675 €  
Gestora: 360 CorA SGIIC, S.A.  
  
Depositario: UBS Europe SE  
Auditor: PWC Auditores, S.L.  
  
C. Gestión: 0,80%  
C. Éxito: 9% sobre resultado positivo  
  
Contacto: info@360cora.com  
C/ Antonio Maura 7, B/ Iz.  
28014 Madrid  
915 637 159



\*\* La fecha de inicio de la grafica corresponde a la primera operación realizada en el fondo, no a la fecha de creación del fondo.

VALOR LIQUIDATIVO Y RENTABILIDADES

	ene-20	feb-20	mar-20	abr-20	may-20	jun-20	jul-20	ago-20	sep-20	oct-20	nov-20	dic-20	YTD
VL CODEX GLOBAL	-	-	-	-	-	-	9,953	10,130	10,272	10,216			10,216
RENT CODEX GLOBAL	-	-	-	-	-	-	-0,23%	1,77%	1,41%	-0,55%			2,16%

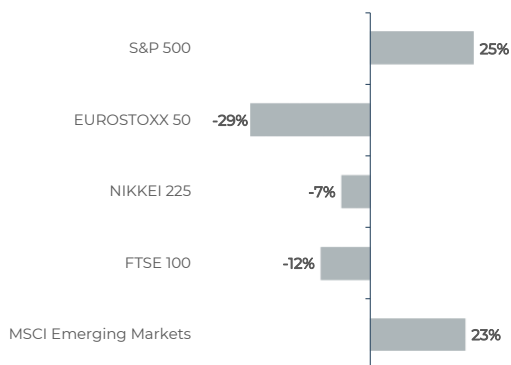
DESCRIPCIÓN

Codex Equity Index Fund es un fondo con valor liquidativo diario cuyo objetivo es obtener retornos positivos y estables en el tiempo invirtiendo en **posiciones largas y cortas en futuros** sobre cinco de los mayores índices regionales de renta variable (S&P 500, Nikkei 225, Ftse 100, Eurostoxx 50 y MSCI Mercados Emergentes), de forma que en el momento de la asignación de pesos la suma neta de dichas posiciones esté lo más próxima a cero.

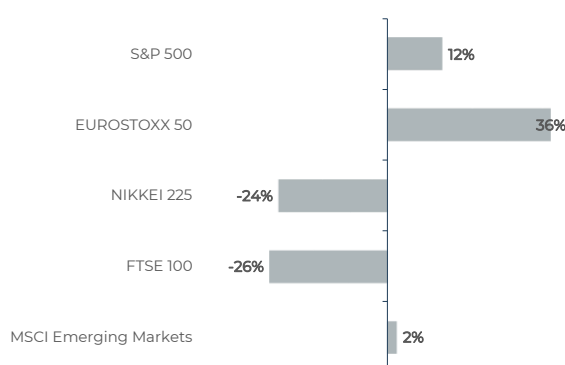
Se espera que el comportamiento relativo entre dichos mercados comporte una rentabilidad positiva neta, en la medida en que las distintas posiciones en el fondo sobre aquellos futuros para los que la decisión es compradora se aprecien más (o se deprecien menos) que aquellas para las que la decisión es vendedora. La suma en valor absoluto de las posiciones es equivalente al 100% de la cartera, por lo que el fondo **no utiliza apalancamiento**.

OPERACIONES CERRADAS DURANTE EL MES

Distribución Activos 1ª Operación



Distribución Activos 2ª Operación



Distribución Probabilidad 1ª Operación



▲ : Nivel de VaR al 90%  
▲ : Nivel de VaR al 95%

● % de rentabilidad obtenida en la operación **1,60%**  
Inicio **23 de septiembre de 2020**  
Cierre **07 de octubre de 2020**

Distribución Probabilidad 2ª Operación

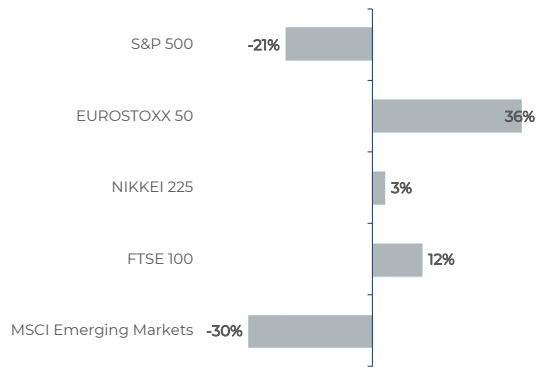


▲ : Nivel de VaR al 90%  
▲ : Nivel de VaR al 95%

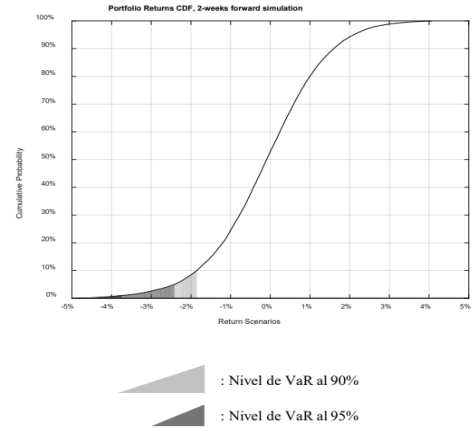
● % de rentabilidad obtenida en la operación **-0,25%**  
Inicio **07 de octubre de 2020**  
Cierre **21 de octubre de 2020**

OPERACIONES ABIERTAS Y VIVAS A CIERRE DE MES

Distribución Activos 3ª Operación



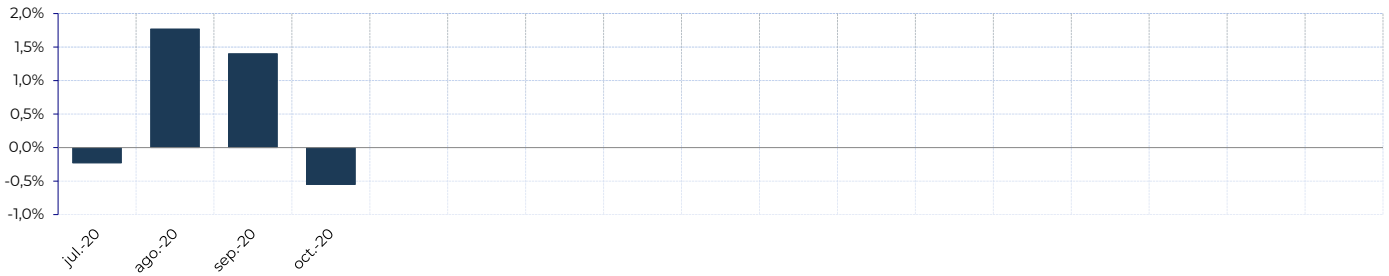
Distribución Probabilidad 3ª Operación



Inicio 21 de octubre de 2020

RENTABILIDAD HISTÓRICA

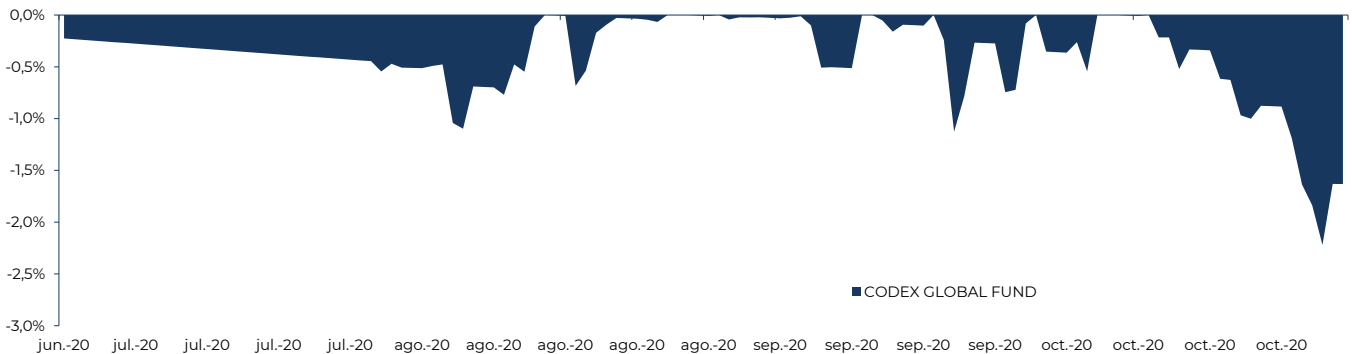
	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	AÑO	+	-
2020							-0,23%	1,77%	1,41%	-0,55%			2,16%	2	2



Datos Cartera

Ratio Sharpe	1,54
Ratio Sortino	2,40
Ratio Omega	1,36
Utilización derivados	SI

RECUPERACIÓN DE NUEVOS MÁXIMOS DESPUÉS DE CORRECCIONES (0 = NUEVOS MÁXIMOS)



Esta gráfica muestra el tiempo en recuperar el máximo histórico (0=nuevo máximo histórico) y la profundidad de cada caída desde máximo hasta mínimo del fondo.