

IGC

International Group Corporation

Reporte Ejecutivo de Rendimiento de Cartera

AÑO FISCAL 2025

Período: 28 Mayo – 31 Diciembre 2025

Preparado para: Inversores y Alta Dirección

7 Meses

Período analizado

7

Subfondos activos

USD / EUR

Divisas de operación

La Cartera Ha Triplicado Su Valor en 7 Meses

+252.82%

ROI USD

\$924.85 → \$3,263.07
Ganancia: +\$2,338.22

+203.36%

ROI EUR

€529.29 → €1,605.62
Ganancia: +€1,076.33

+234.82%

ROI Combinado

Capital propio sin flujos externos
\$1,454.13 → \$4,868.69

+\$3,414

Ganancia Total

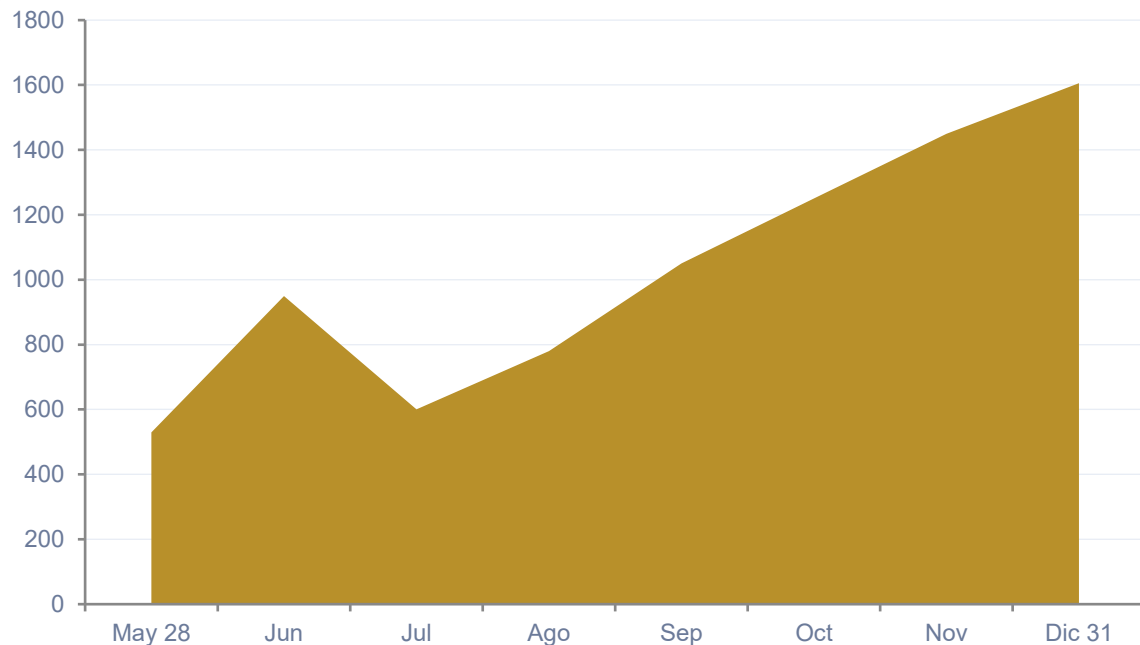
Resultado neto combinado
Año Fiscal 2025

ROI calculado sobre capital inicial 100% propio, sin flujos externos de capital. Período: 28 mayo – 31 diciembre 2025 (7 meses). Para análisis con aportaciones o retiradas se recomienda metodología TWR o MWR/IRR.

Evolución del Capital en Dólares — May–Dic 2025

**+5.89%**Retorno semanal
(media aritmética)**79.2%**Win Rate
19/24 semanas positivas**+21.34%**Mejor semana
registrada**-22.74%**Peor semana
Noviembre

Evolución del Capital en Euros — May–Dic 2025

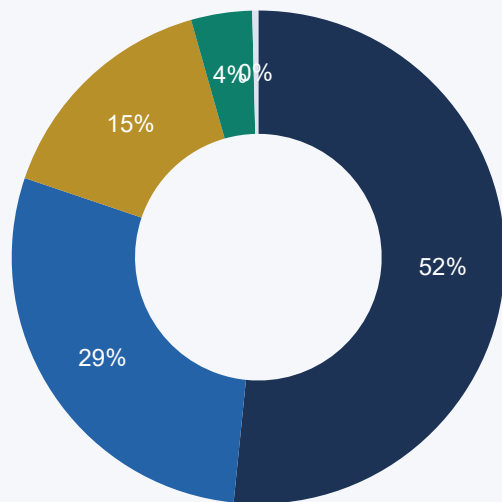
**+6.85%**Retorno semanal
(media aritmética)**58.3%**Win Rate
14/24 semanas positivas**+65.19%**Mejor semana
registrada**-50.26%**Max Drawdown
Jul: €1,197→€600

¹ Max DD EUR (-50.26%) supera benchmarks institucionales: Hedge Funds 10-20%, CTA 15-25%, High Risk Trading 30-40%. Requiere revisión de política de riesgo.

USD vs EUR — Indicadores Clave del Período

Indicador	USD	EUR	Observación
ROI Total del Período	+252.82%	+203.36%	Sin flujos externos de capital
Retorno Semanal Promedio	+5.89%	+6.85%	Media aritmética del período
Volatilidad Semanal	9.89%	21.79%	EUR 2.2× más volátil que USD
Máximo Drawdown	-22.74%	-50.26%	EUR supera todos los benchmarks
Sharpe Ratio (Rf=4.5%aa)	0.59	0.31	Anualizados; USD: aceptable
Sortino Ratio	0.79	0.53	Solo volatilidad bajista
Win Rate	79.2%	58.3%	Semanas con retorno positivo
Mejor Semana	+21.34%	+65.19%	
Ratio Ganancia/Pérdida	1.13:1	1.50:1	

Distribución del Capital por Contraparte (Brokers OTC)



■ Multibank Group ■ VT Markets ■ Doo Prime
■ Renta 4 Banco ■ Otros

Multibank Group — 51.6%

\$2,512.43 · ROI +204.6%

Contraparte principal · Broker OTC

VT Markets — 28.6%

\$1,393.49 · ROI +175.4%

2ª contraparte · Broker OTC

Doo Prime — 15.4%

\$750.64 · ROI +650.6%

3ª contraparte · Broker OTC

Renta 4 Banco — 4.0%

\$192.98 · ROI +1,829.8%*

**Capital inicial \$10 · Baja materialidad (< 1% NAV)*

Los subfondos operan con brokers OTC de derivados. La diversificación es de contraparte, no de clase de activo. Riesgo de contraparte consolidado: Multibank + VT Markets = 80.2% del capital.

Ranking de Subfondos — Ponderado por Volumen de Capital



Multibank Group

+204.6%

\$824.85 → \$2,512.43

Motor principal · 51.6% del NAV



Doo Prime

+650.6%

\$100 → \$750.64

Alto ROI, base material significativa



VT Markets

+175.4%

\$505.92 → \$1,393.49

Sólido y consistente · 28.6% NAV

4º

Renta 4 Banco*

+1,829.8%

\$10 → \$192.98

**Excluido del ranking ponderado (< 1% NAV)*

Bajo rendimiento:

Criptomonedas ROI -19.6% (\$23.21→\$18.67) · rendimiento negativo sostenido — se recomienda revisión de la posición. | Préstamos: cerrado, capital recuperado. | Neowintech: valor residual mínimo.

Análisis de Volatilidad, Drawdown y Riesgo de Contraparte

MÁXIMO DRAWDOWN

-50.26%

EUR · Julio
€1,197 → €600

-22.74%

USD · Nov
\$3,435 → \$2,654

Comparativa sectorial:

Hedge Funds: 10-20%

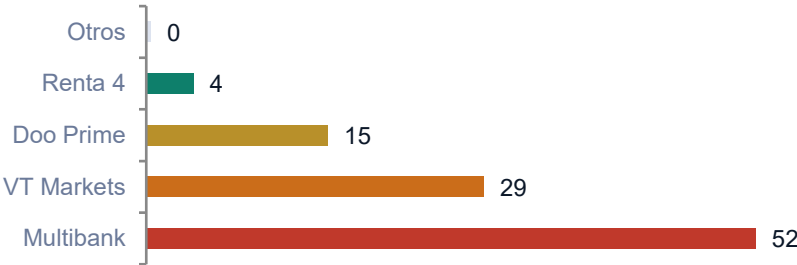
CTA / Managed Futures: 15-25%

High Risk Trading: 30-40%

Cartera EUR: 50.26% — Supera todos

RIESGO DE CONTRAPARTE

Top 2 brokers OTC concentran el 80.2% del capital



RATIOS DE RENDIMIENTO AJUSTADO AL RIESGO — ANUALIZADOS (Rf = 4.5% aa)

Ratio	USD	EUR	Interpretación
Sharpe (Rf=4.5% aa)	0.59	0.31	USD: aceptable para perfil high-yield · EUR: insuficiente dado el riesgo
Sortino (vol. bajista)	0.79	0.53	USD: más eficiente excluyendo volatilidad alcista
Volatilidad Semanal	9.89%	21.79%	EUR duplica la volatilidad del fondo USD

Detalle de Resultados por Divisa — Año Fiscal 2025

3.53x

Multiplicador USD

\$924.85 → \$3,263.07
Ganancia neta: +\$2,338.22

3.03x

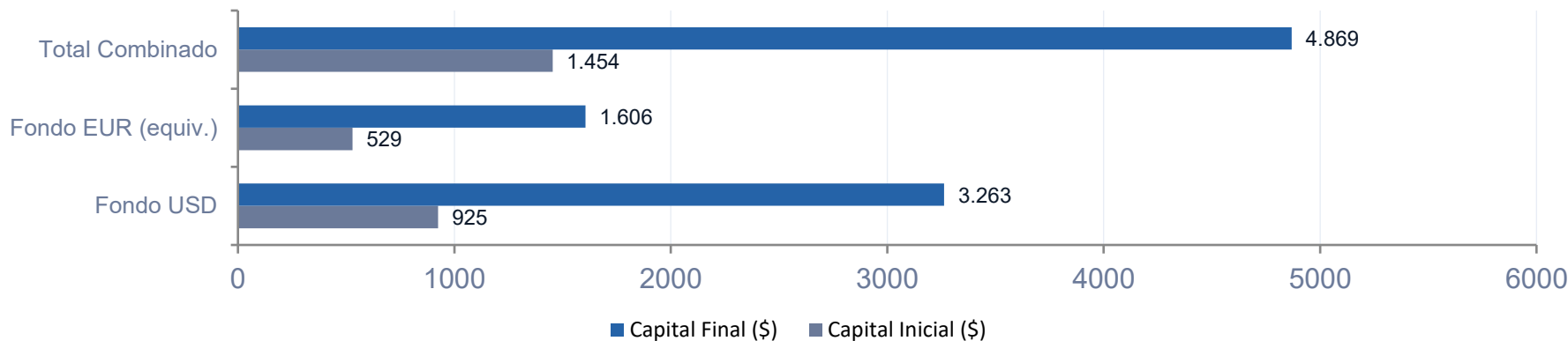
Multiplicador EUR

€529.29 → €1,605.62
Ganancia neta: +€1,076.33

+\$3,414

Ganancia Combinada

Capital \$1,454.13 → \$4,868.69
Año Fiscal 2025



Outlook 2026: Base Sólida para Crecimiento Sostenido

Fortalezas	Áreas de Atención	Recomendaciones 2026
- ROI combinado +234.82% en 7 meses sobre capital 100% propio - Win Rate USD del 79.2% — consistencia operativa demostrada - Operación diversificada en 7 contrapartes distintas - Capacidad de recuperación demostrada tras drawdowns	80.2% del capital en 2 brokers OTC — riesgo de contraparte ALTO - Fondo EUR: volatilidad 21.79% semanal · Max DD -50.26% - Criptomonedas: rendimiento negativo sostenido (-19.6%) - Ausencia de métricas CAGR, Calmar ratio y TWR/IRR	- Mantener estrategia USD — Sharpe 0.59, sólido y consistente - Rebalancear: reducir Multibank, ampliar Doo Prime y Renta 4 - Implementar stop-loss EUR con drawdown máximo admisible del 25% - Adoptar metodología TWR y ampliar track record a 36+ meses