

Rentabilidades

	Cat Patrimonis	Ibex- 35	Eurostoxx 50
2008	-21,47 %	-39,96 %	-41,09 %
2007	4,34 %	7,32 %	6,79 %
2006	18,96 %	31,79 %	15,12 %
2005	17,05 %	18,20 %	21,27 %
2004	12,44 %	17,37 %	6,90 %
2003	24,81 %	28,16 %	15,68 %
2002	-4,07 %	-27,94 %	-36,46 %
2001	4,67 %	-7,52 %	-19,05 %
2000	6,92 %	-21,75 %	-2,69 %

Volatilidades

	Cat Patrimonis	Ibex- 35	Eurostoxx 50
2008	19,47%	38,56%	35,86%
2007	7,25%	16,23%	15,65%
2006	8,08%	13,85%	14,97%
2005	5,63%	10,27%	11,22%
2004	9,50%	13,05%	14,15%
2003	13,07%	21,21%	28,35%
2002	15,18%	32,18%	39,30%
2001	14,48%	28,02%	27,36%
2000	11,01%	19,50%	20,83%

Indicadores de gestión

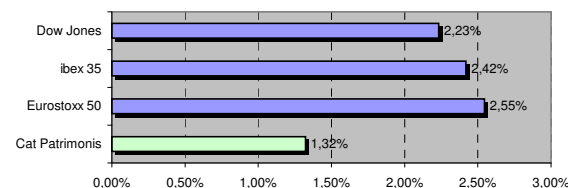
Para últimos 365 días

	Cat Patrimonis	Ibex- 35	Eurostoxx 50
Sharpe (*)	-1,45	-1,32	-1,37
Ibex 35			
α de Jensen(*)	-11,07%		
β	0,32		
Treynor (*)	-0,84	-0,47	
M2	-4,77%		
Coef. De Correl.	63,80%		
Eurostoxx 50			
α de Jensen(*)	-9,88%		
β	0,36		
Treynor (*)	-0,74		-0,44
M2	-2,60%		
Coef. De Correl.	66,01%		

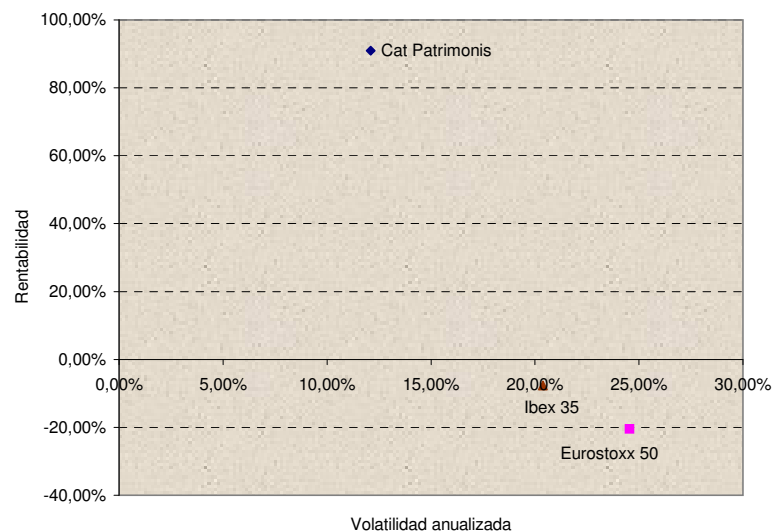
(*) Tipo libre de riesgo: media euribor 1 semana

(**) Value at Risk al 95% de probabilidad

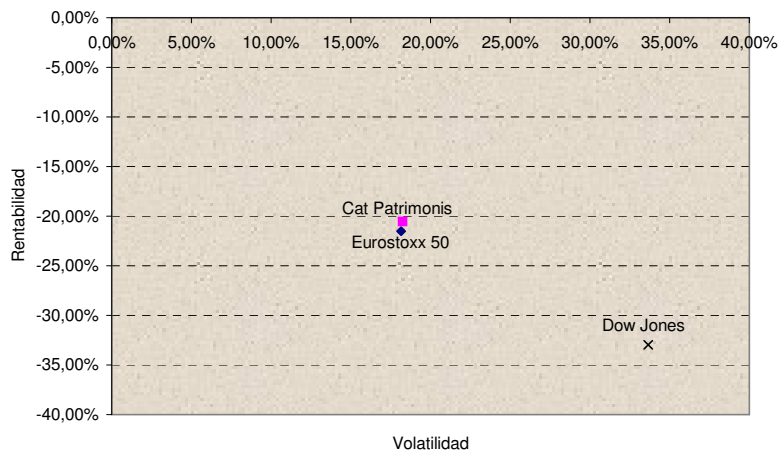
VaR 5 días (media 2 últimos años)



Desde inscripción en la CNMV (27 noviembre 1998)



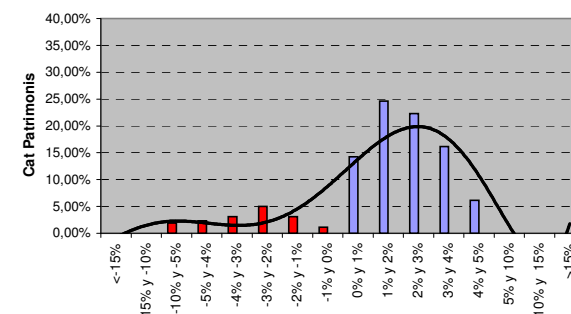
Últimos 365 días



Análisis de las rentabilidades

Rentabilidades en intervalos de 30 días (últimos 365 días)

Distribución frecuencias rentabilidades 30 días



	Rentabilidad 30 días	Peor	Mejor
Cat Patrimonis		-7,28%	4,57%
Ibex 35		-30,58%	8,94%
Eurostoxx 50		-28,50%	9,85%

% Rentabilidades 30 días positivas

Cat Patrimonis	83,46%
Ibex 35	30,38%
Eurostoxx 50	29,23%

Distribución frecuencias rentabilidades 30 días

