

Objetivo de inversión

Fondo de renta variable mixta internacional principalmente mercados OCDE que invertirá, directa o indirectamente a través de IIC, un 30-75% de la exposición total en renta variable, si bien normalmente dicha exposición será del 60%, de cualquier capitalización y sector. El resto de la exposición será en renta fija publica/privada (incluyendo depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, líquidos). La exposición al riesgo divisa estará entre el 0-75% de la exposición total, pudiéndose invertir hasta un 30% en emisores/mercados emergentes.

Gestor

Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. los 17 anteriores años los pasó como vicedirector de trading con derivados Gesmosa-GBI.

Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
Fondo 2022	-2,69	-1,97	1,93	-2,03	-2,71	-5,66	6,32	-2,74	--	--	--	--	-9,59
Índice	-2,30	-1,53	1,86	-2,32	-1,14	-3,90	5,78	-1,60	--	--	--	--	-5,34
Fondo 2021	0,54	0,87	4,09	0,34	0,86	1,78	0,18	1,38	-2,12	2,79	-0,24	2,44	13,55
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,35 -0,35
Fondo 2020	-0,29	-5,49	-10,74	7,93	1,29	2,38	0,81	1,83	-0,62	-1,04	5,18	1,68	1,64
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2019	6,05	1,61	2,01	1,62	-3,10	3,30	2,22	0,07	1,48	0,12	1,79	1,42	19,95
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2018	-1,36	-1,49	-1,37	-1,13	-0,87	-0,72	1,32	-0,37	0,14	-3,20	0,92	-3,95	-11,55
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2017	--	--	--	--	--	--	--	--	0,79	0,17	-0,81	-0,26	-0,11
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Escala de riesgo

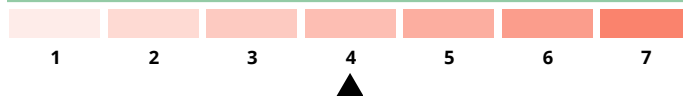
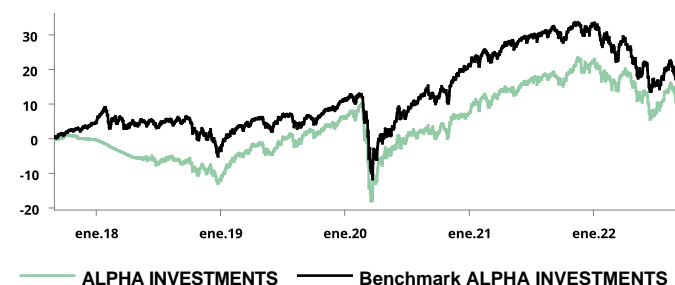


Gráfico del fondo



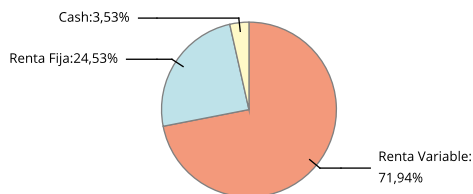
Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	-2,74	-1,60
Rentabilidad últimos 3 meses	-2,45	0,04
Rentabilidad del año	-9,59	-5,34
Rentabilidad desde creación	10,58	-5,67
Rentabilidad anualizada	2,12	-1,13
Volatilidad anualizada	11,26	0,08
Ratio de Sharpe	-0,62	-0,54
Ratio de información	-0,15	--
Beta	0,94	--
Número de posiciones	15	

Mayores pesos

	51,70% del fondo
iShares Core S&P 500 UCITS ETF	16,06%
Xtrackers MSCI Emerging Market ETF	11,11%
Xtrackers II EUR Corporate Bon ETF	8,70%
Vanguard USD Emerging Markets ETF	8,55%
Xtrackers II Eurozone Governme ETF	7,28%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Cash	3,53%
Fondos	96,47%

Distribución rating

Cash	3,53%
AA	7,28%
A	8,70%
BBB	8,55%
NR	71,94%

Distribución geográfica

Cash	3,53%
Irlanda	60,41%
Estados Unidos	20,08%
Luxemburgo	15,99%

Distribución cartera RF

Corporativa	24,53%
--	--
Cash	3,52%
NR	71,95%

Distribución por divisas

EUR	58,74%
USD	41,26%

Distribución vencimientos

Cash	3,53%
------	-------

Datos del fondo

Datos Registrales		Datos Generales		Datos	
Código ISIN	ES0139099008	Gestora	TREA ASSET MANAGEMEN	Comisión Gestión	1,00%
Bloomberg	FOVAREF SM Equity	Depositaria	CECABANK	Comisión Custodia	0,10%
Fecha de creación	19/04/2012	Auditor	DELOITTE,S.L	Valor liquidativo	9,28 EUR
Nombre del gestor	Federico Battaner			Patrimonio	6.425.882,21 EUR