

TREA RENTA FIJA, FI

RENDA FIJA EURO

31 de Agosto de 2022

Objetivo de inversión

Fondo de renta fija euro que invertirá en activos de renta fija pública y/o privada, incluidos depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, que sean líquidos. Al menos un 75% de la cartera tendrá un rating igual o superior a la del Reino de España o Investment Grade. Hasta un 25% de la cartera podrá estar invertido en activos con rating inferior, con un mínimo de B-. La duración media de la cartera será superior a un año, aunque normalmente oscilará entre 2 y 5 años.

Gestor

Ascensión Gómez, es la gestora principal del fondo y líder del equipo de Renta Fija de Trea Capital. Aporta 20 años de experiencia y es la responsable de la selección de valores.

Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
Fondo 2022	-0,91	-2,00	-0,96	-1,87	-1,05	-3,14	2,84	-2,20	--	--	--	--	-9,03
Índice	-1,40	-2,74	-1,36	-2,92	-1,26	-3,42	5,00	-4,59	--	--	--	--	-12,28
Fondo 2021	-0,12	-0,29	0,12	0,06	-0,06	-0,05	0,57	-0,24	-0,35	-0,67	0,11	-0,18	-1,11
Índice	-0,22	-0,90	0,10	-0,02	-0,19	0,45	1,23	-0,47	-0,72	-0,72	0,18	-0,12	-1,40
Fondo 2020	0,32	-0,36	-4,30	1,55	0,32	0,84	0,72	0,20	-0,01	0,14	0,44	-0,04	-0,29
Índice	1,27	-0,42	-7,04	4,31	0,07	1,27	1,58	0,04	0,33	0,85	0,89	0,08	2,89
Fondo 2019	0,71	0,56	0,74	0,68	-0,40	0,91	0,55	0,23	-0,44	-0,12	-0,17	0,08	3,36
Índice	1,09	0,71	1,44	0,65	-0,13	1,60	1,49	0,61	-0,90	-0,19	-0,36	-0,12	6,00
Fondo 2018	0,21	-0,54	-0,19	0,05	-1,17	-0,29	0,33	-0,26	-0,27	-0,41	-0,97	0,03	-3,42
Índice	-0,36	0,04	-0,09	0,02	-0,21	0,08	0,19	0,03	-0,32	-0,12	-0,60	0,24	-1,11
Fondo 2017	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,11	0,77	-0,16	-0,15	0,35
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,28	1,01	-0,18	-0,33	0,21

Escala de riesgo

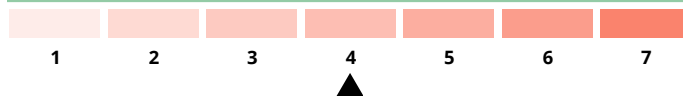
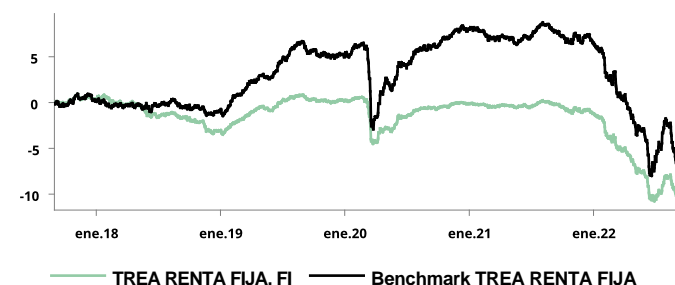


Gráfico del fondo



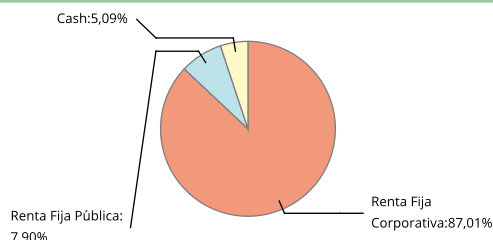
Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	-2,20	-4,59
Rentabilidad últimos 3 meses	-2,58	-3,25
Rentabilidad del año	-9,03	-12,28
Rentabilidad desde creación	-10,14	-6,51
Rentabilidad anualizada	-2,03	-1,30
Volatilidad anualizada	2,93	0,05
Ratio de Sharpe	-3,38	-2,57
Ratio de información	1,45	--
Duración	3,10 años	
Tir	4,49%	
Rating	BBB	
Número de posiciones	66	

Mayores pesos

	15,55% del fondo
C 1.45 09/30/25	3,96%
ATRADI 5,25% 09/44	3,01%
BACR 1 7/8 12/08/23	2,89%
NOSPL 1 1/8 05/02/23	2,85%
ARION 1 03/20/23	2,84%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Cash	5,09%
Financiero	48,50%
Comunicaciones	12,29%
Consumo No Cíclico	8,20%
Gobierno	7,90%
Utilities	6,48%
Energía	3,96%
Industrial	2,59%
Consumo Cíclico	2,38%
Otros	2,60%

Distribución vencimientos

Cash	5,09%
<1 año	19,40%
Entre 1 y 2 años	16,42%
Entre 2 y 3 años	17,29%
Entre 3 y 5 años	22,16%
Entre 5 y 7 años	11,65%
>7 años	7,99%

Distribución geográfica

Cash	5,09%
España	18,09%
Francia	10,76%
Gran Bretaña	10,29%
Otros	55,75%

Distribución cartera RF

Corporativa	87,00%
Gobierno	7,90%
--	--
Cash	5,10%
Investment Grade	88,58%
High Yield	6,32%

Distribución por divisas

EUR	98,65%
USD	1,35%

Distribución rating

Cash	5,09%
AA	3,60%
A	34,51%
BBB	50,47%
BB	6,32%

Datos del fondo

Datos Registrales		Datos Generales		Datos	
Código ISIN	ES0168662031	Gestora	TREA ASSET MANAGEMENT	Comisión Gestión	1,20%
Bloomberg	FONPSRF SM Equity	Depositaria	CECABANK	Comisión Custodia	0,05%
Fecha de creación	24/03/1999	Auditor	DELOITTE,S.L	Valor liquidativo	99,12 EUR
Nombre del gestor	Ascensión Gómez			Patrimonio	7.018.957,26 EUR