

VALOR GLOBAL, FI

GLOBAL

31 de Octubre de 2023

Objetivo de inversión

Fondo global que podrá invertir de manera diversificada, directa o indirectamente a través de IIC, en renta variable y renta fija, sin preestablecer ningún porcentaje por activo ni límite por capitalización, calidad crediticia, etc. Tanto los emisores como los mercados en que cotizan los activos serán principalmente OCDE. No obstante, se podrá invertir hasta un 30% de la exposición total en emisores y/o mercados emergentes. El riesgo divisa podrá llegar al 60% de la exposición total.

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 broker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. los 17 anteriores años los pasó como vicedirector de trading con derivados Gesmosa-GBI.

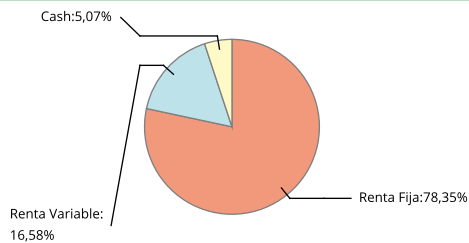
Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
Fondo 2023	3,47	-0,12	0,19	-0,40	0,33	0,43	1,26	-0,33	-0,24	-0,51	--	--	4,08
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2022	-1,51	-1,29	1,26	-1,02	-0,68	-2,40	1,86	-0,82	-2,95	0,04	2,15	-2,19	-7,43
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2021	2,32	-1,17	-0,07	0,84	1,00	1,88	-1,61	0,36	-0,29	1,70	-1,12	1,74	5,63
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2020	-0,19	-3,32	-12,31	5,21	0,93	1,30	-3,06	1,83	--	-3,00	14,28	1,00	-2,01
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2019	4,77	1,16	1,87	1,39	-5,93	2,12	1,06	-0,81	0,69	0,82	1,47	0,40	9,01
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2018	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-2,31	-5,71	-7,88
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	-0,51	--
Rentabilidad últimos 3 meses	-1,08	--
Rentabilidad del año	4,08	--
Rentabilidad desde creación	-8,77	--
Rentabilidad anualizada	-1,26	--
Volatilidad anualizada	3,51	--
Ratio de Sharpe	1,18	--
Ratio de información	--	--
Duración	1,30 años	--
Tir	4,81%	--
Rating	A-	--
Número de posiciones	56	--

Riesgo por exposición



Distribución rating

Cash	5,07%
AAA	10,93%
AA	11,66%
A	18,47%
BBB	28,83%
BB	2,67%
B	2,55%

Distribución vencimientos

Cash	5,07%
<1 año	37,11%
Entre 1 y 2 años	15,77%
Entre 2 y 3 años	11,57%
Entre 3 y 5 años	1,90%
Entre 5 y 7 años	0,97%
>7 años	2,60%

Datos del fondo

Datos Registrales		Datos Generales		Datos	
Código ISIN	ES018272006	Gestora	TREA ASSET MANAGEMEN	Comisión Gestión	1,25%
Bloomberg	--	Depositaria	CECABANK	Comisión Custodia	0,10%
Fecha de creación	18/11/2016	Auditor	DELOITTE,S.L	Valor liquidativo	9,12 EUR
Nombre del gestor	--			Patrimonio	18.685.095,51 EUR

Escala de riesgo

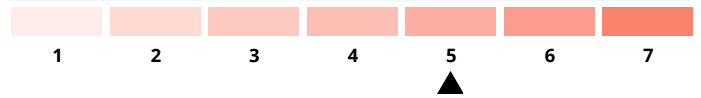


Gráfico del fondo



Mayores pesos Cartera Renta Fija

	15,43% del fondo
SGLT 0 01/12/24	6,38%
SGLT 0 02/09/24	5,30%
Ruffer Total Return International O	3,75%

Mayores pesos Cartera Renta Variable

	9,62% del fondo
Gamma Global FI	3,39%
ETF Lyxor Core STOXX Europe 600 DR	3,37%
ETF SPDR S&P500 Trust	2,86%

Distribución por sectores

Cash	5,07%
Financiero	31,83%
Gobierno	25,64%
Fondos	21,46%
Consumo Ciclico	5,28%
Consumo No Ciclico	3,82%
Comunicaciones	2,76%
Industrial	2,55%
Energia	1,04%
Utilities	0,56%

Distribución geográfica

Cash	5,07%
España	33,06%
Estados Unidos	11,27%
Francia	7,27%
Otros	43,33%

Distribución por divisas

EUR	86,17%
USD	13,83%

Distribución cartera RF

Corporativa	67,28%
Gobierno	32,72%
--	--
Investment Grade	92,53%
High Yield	7,47%