TREA CONSERVADOR, P.P. (N0231)

RENTA FIJA MIXTA EURO

31 de Mayo de 2022

Objetivo de inversión

Invertirá entorno a un 20% de su patrimonio en renta variable negociada preferentemente en el mercado español y europeo, sin descartar otros mercados de la OCDE. Puntualmente el fondo podrá asumir una mayor o menor ponderación en renta variable, aunque nunca superior al 30%. El resto del patrimonio podrá estar invertido en acproduzcan bajadas sobrevenidas de rating, las posiciones afectadas se mantendrán en cartera. Podrá invertir en depósitos a la vista, instrumentos del mercado monetario e IIC´s.

Gestor

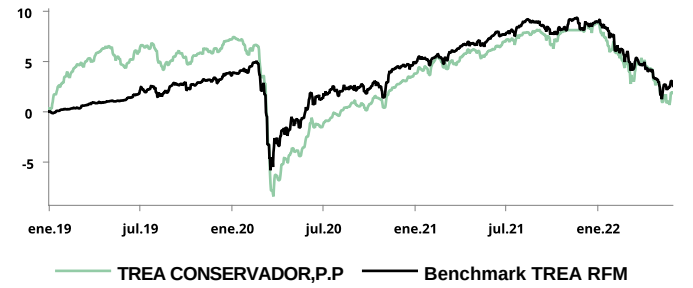
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector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

Tipo de partícipe a quien se dirige y perfil de riesgo

Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
Fondo 2022	-2,04	-1,57	-0,13	-1,74	-1,07	--	--	--	--	--	--	--	-6,39
Índice	-1,33	-1,57	-1,06	-1,39	-0,61	--	--	--	--	--	--	--	-5,82
Fondo 2021	-0,15	0,73	0,65	0,96	-0,02	0,81	0,62	0,37	-1,31	1,44	-0,48	0,66	4,33
Índice	-0,20	0,14	1,46	0,33	0,50	0,39	0,85	0,27	-0,93	0,27	0,02	0,74	3,89
Fondo 2020	-1,34	-2,13	-9,48	2,89	1,16	1,04	1,08	1,29	-0,31	-0,17	2,34	1,03	-3,15
Índice	0,28	-1,73	-4,58	1,95	0,90	1,15	0,21	0,61	-0,03	-0,71	2,81	0,53	1,20
Fondo 2019	--	1,21	0,34	1,44	-2,00	1,48	0,30	-1,19	0,45	0,34	0,45	0,83	6,83
Índice	--	0,04	0,55	0,13	0,13	0,61	0,55	0,18	0,43	-0,07	0,36	0,32	3,59
Fondo 2018	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	3,08	--
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,31	--

Gráfico del fondo

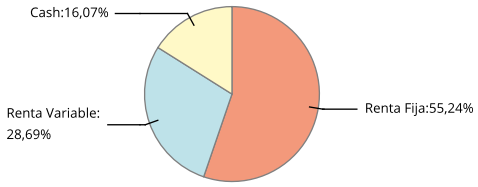


Estadísticas	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	-1,07	-0,61
Rentabilidad últimos 3 meses	-2,91	-3,03
Rentabilidad del año	-6,39	-5,82
Rentabilidad desde creación	1,06	2,57
Rentabilidad anualizada	0,31	0,75
Volatilidad anualizada	3,87	0,04
Ratio de Sharpe	-0,99	-1,14
Ratio de información	-0,04	--
Duración	1,20 años	
Tir	2,44%	
Rating	BBB+	
Número de posiciones	22	

Mayores pesos Cartera Renta Fija	15,65% del fondo
GLENLN 1 7/8 09/13/23	5,23%
VW 2.7 PERP	5,23%
DANBNK 1 5/8 03/15/24	5,19%

Mayores pesos Cartera Renta Variable	18,82% del fondo
Valentum FI	8,30%
Eleva UCITS Fund - Eleva Absol	6,15%
Vontobel Fund - US Equity	4,37%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Cash	16,07%
Fondos	28,69%
Financiero	20,53%
Comunicaciones	12,97%
Recursos Basicos	5,23%
Consumo Ciclico	5,23%
Energia	5,05%
Gobierno	2,44%
Inv. Inmobiliarias	2,41%
Industrial	1,38%

Distribución rating

Cash	16,07%
AAA	2,44%
A	12,65%
BBB	40,16%
NR	28,69%

Distribución geográfica

Cash	16,07%
España	23,65%
Francia	10,82%
Luxemburgo	9,00%
Otros	40,47%

Distribución vencimientos

Cash	16,07%
<1 año	18,06%
Entre 1 y 2 años	23,28%
Entre 2 y 3 años	9,06%
Entre 3 y 5 años	4,85%

Distribución por divisas

EUR	97,55%
USD	2,45%

Distribución cartera RF

Corporativa	100,00%
--	--
Investment Grade	65,82%
NR	34,18%

Datos del fondo y el plan

Datos Registrales		Datos Generales		Datos	
Nombre del fondo	TREA RFM	Gestora	Trea Pensiones	Comisión Gestión	1,30%
Defensor partícipe	PREVIGALIA	Depositaria	CECABANK	Comisión Custodia	0,20%
Fecha de creación	12/12/1989	Nº partícipes	4.871	Valor liquidativo	18,08 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	63	Patrimonio	3.885.351,63 EUR