

TREA CONSERVADOR, P.P. (N0231)

RENDA FIJA MIXTA EURO

28 de Febrero de 2023

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 apoduzcan 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

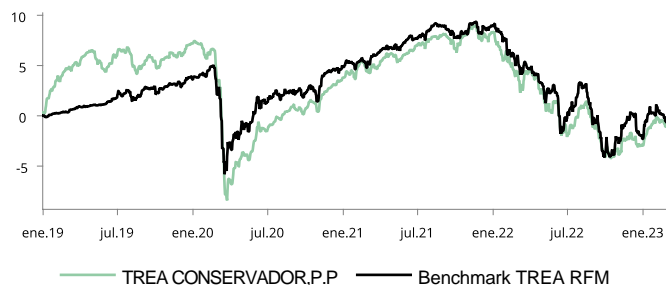
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector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

Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
Fondo 2023	2,36	-0,28	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	2,07
Índice	2,40	-0,70	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,68
Fondo 2022	-2,04	-1,57	-0,13	-1,74	-1,07	-3,45	2,95	-1,76	-3,12	0,83	1,57	-1,20	-10,41
Índice	-1,33	-1,57	-1,06	-1,39	-0,61	-2,77	3,51	-3,63	-3,14	1,31	2,19	-2,08	-10,30
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

Tipo de partícipe a quien se dirige y perfil de riesgo

Gráfico del fondo



Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	-0,28	-0,70
Rentabilidad últimos 3 meses	0,84	-0,43
Rentabilidad del año	2,07	1,68
Rentabilidad desde creación	-1,28	-0,66
Rentabilidad anualizada	-0,31	-0,16
Volatilidad anualizada	4,81	0,06
Ratio de Sharpe	-1,05	-1,01
Ratio de información	0,23	--
Duración	0,63 años	
Tir	4,23%	
Rating	BBB+	
Número de posiciones	37	

Mayores pesos Cartera Renta Fija

	17,64% del fondo
NOSPL 1 1/8 05/02/23	5,91%
GLENLN 1 7/8 09/13/23	5,87%
CLNXSM 2 7/8 04/18/25	5,86%

Mayores pesos Cartera Renta Variable

	13,52% del fondo
Fidelity Funds - Global Technology A	7,38%
Valentum FI	5,14%
Roche AG-Genuss	1,00%

Distribución por sectores

Cash	15,17%
Financiero	27,08%
Comunicaciones	15,40%
Fondos	12,51%
Recursos Basicos	6,54%
Energia	6,53%
Consumo Ciclico	4,91%
Industrial	3,06%
Tecnologia	2,83%
Otros	5,97%

Distribución geográfica

Cash	15,17%
España	24,13%
Francia	10,01%
Luxemburgo	7,38%
Otros	43,31%

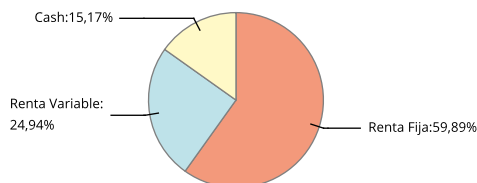
Distribución por divisas

EUR	88,88%
USD	9,61%
CHF	1,03%
Otros	0,48%

Distribución cartera RF

Corporativa	100,00%
--	--
Investment Grade	100,00%

Riesgo por exposición



Distribución rating

Cash	15,17%
AAA	2,75%
AA	5,88%
A	15,09%
BBB	40,73%
BB	0,39%

Distribución vencimientos

Cash	15,17%
<6 meses	29,29%
Entre 6 y 12 meses	8,73%
Entre 12 y 18 meses	8,70%
Entre 18 y 24 meses	7,43%
Entre 2 y 3 años	5,74%

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	4.802	Valor liquidativo	17,66 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	40	Patrimonio	3.402.381,29 EUR