

TREA CONSERVADOR, P.P. (N0231)

RENDA FIJA MIXTA EURO

31 de Agosto 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

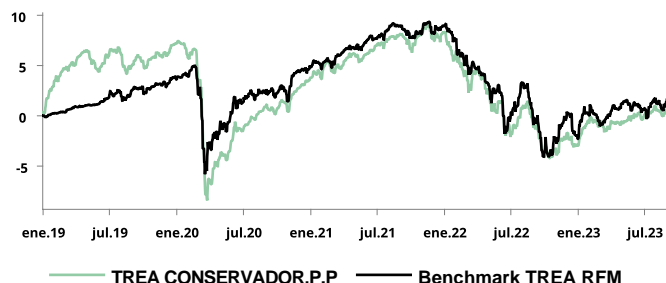
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector 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	0,42	-0,05	0,27	0,44	0,85	-0,11	--	--	--	--	3,94
Índice	2,40	-0,70	1,11	0,75	-0,26	-0,20	1,03	-0,19	--	--	--	--	3,98
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	-0,11	-0,19
Rentabilidad últimos 3 meses	1,18	0,64
Rentabilidad del año	3,94	3,98
Rentabilidad desde creación	0,53	1,58
Rentabilidad anualizada	0,11	0,34
Volatilidad anualizada	3,50	0,05
Ratio de Sharpe	0,58	0,46
Ratio de información	-0,08	--
Duración	1,28 años	
Tir	4,12%	
Rating	A-	
Número de posiciones	29	

Mayores pesos Cartera Renta Fija

	19,11% del fondo
GLENLN 1 7/8 09/13/23	6,43%
CABKSM 4 5/8 05/16/27	6,39%
DANBNK 1 5/8 03/15/24	6,29%

Mayores pesos Cartera Renta Variable

	15,24% del fondo
Fidelity Funds - Global Technology A	8,85%
Valentum FI	5,36%
Airbus Group NV (FR)	1,03%

Distribución por sectores

Cash	5,64%
Financiero	38,67%
Fondos	14,21%
Gobierno	10,14%
Comunicaciones	10,14%
Recursos Basicos	7,22%
Energía	6,21%
Consumo Cíclico	3,19%
Industrial	2,66%
Otros	1,92%

Distribución geográfica

Cash	5,64%
España	32,21%
Francia	9,19%
Luxemburgo	8,85%
Otros	44,12%

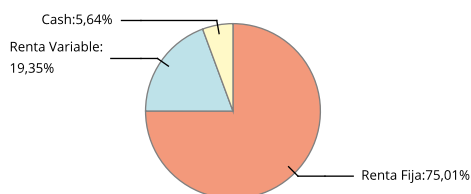
Distribución por divisas

EUR	97,07%
USD	2,93%
CHF	0,00%
Otros	0,00%

Distribución cartera RF

Corporativa	90,38%
Gobierno	9,62%
--	--
Investment Grade	84,07%
NR	15,93%

Riesgo por exposición



Distribución rating

Cash	5,64%
AAA	8,54%
AA	9,53%
A	17,29%
BBB	41,10%
BB	0,47%
NR	17,43%

Distribución vencimientos

Cash	5,64%
<1 año	44,16%
Entre 1 y 2 años	14,24%
Entre 2 y 3 años	12,51%
>7 años	4,11%

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	4.756	Valor liquidativo	17,99 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	50	Patrimonio	3.165.461,80 EUR