

TREA CONSERVADOR, P.P. (N0231)

RENDA FIJA MIXTA EURO

31 de Agosto 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 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

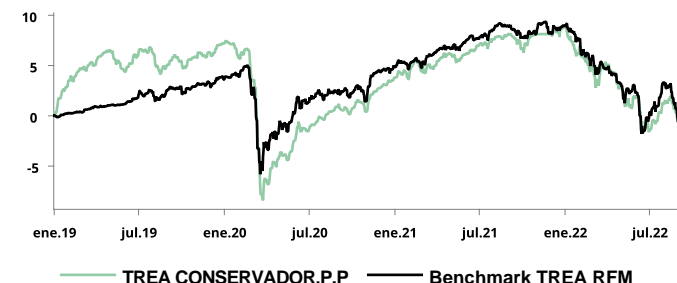
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector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

Rendimientos mensuales y anuales (%)

| | Ene | Feb | Mar | Abr | May | Jun | Jul | Ago | Sep | Oct | Nov | Dic | Año |
|-------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|------|-------|
| Fondo 2022 | -2,04 | -1,57 | -0,13 | -1,74 | -1,07 | -3,45 | 2,95 | -1,76 | -- | -- | -- | -- | -8,60 |
| Índice | -1,33 | -1,57 | -1,06 | -1,39 | -0,61 | -2,77 | 3,51 | -3,63 | -- | -- | -- | -- | -8,65 |
| 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 | -1,76 | -3,63 |
| Rentabilidad últimos 3 meses | -2,36 | -3,00 |
| Rentabilidad del año | -8,60 | -8,65 |
| Rentabilidad desde creación | -1,33 | -0,51 |
| Rentabilidad anualizada | -0,36 | -0,14 |
| Volatilidad anualizada | 4,55 | 0,05 |
| Ratio de Sharpe | -1,71 | -1,73 |
| Ratio de información | 0,07 | -- |
| Duración | 1,18 años | |
| Tir | 4,19% | |
| Rating | BBB+ | |
| Número de posiciones | 26 | |

| Mayores pesos Cartera Renta Fija | 15,90% del fondo |
|--------------------------------------|------------------|
| GLENLN 1 7/8 09/13/23 | 5,34% |
| VW 2.7 PERP | 5,31% |
| NOSPL 1 1/8 05/02/23 | 5,25% |
| Mayores pesos Cartera Renta Variable | 18,16% del fondo |
| Valentum FI | 7,52% |
| Eleva UCITS Fund - Eleva Absol | 6,32% |
| Vontobel Fund - US Equity | 4,32% |

Distribución por sectores

| | |
|------------------|--------|
| Cash | 6,25% |
| Fondos | 28,08% |
| Financiero | 25,34% |
| Comunicaciones | 13,12% |
| Consumo Cíclico | 7,93% |
| Recursos Basicos | 5,34% |
| Energia | 5,02% |
| Utilities | 2,68% |
| Gobierno | 2,62% |
| Otros | 3,62% |

Distribución geográfica

| | |
|----------------|--------|
| Cash | 6,25% |
| España | 24,93% |
| Francia | 10,78% |
| Estados Unidos | 9,56% |
| Otros | 48,49% |

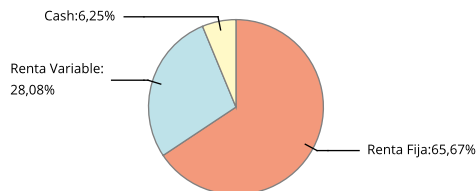
Distribución por divisas

| | |
|-----|--------|
| EUR | 97,37% |
| USD | 2,63% |

Distribución cartera RF

| | |
|------------------|---------|
| Corporativa | 100,00% |
| -- | -- |
| Investment Grade | 67,82% |
| High Yield | 2,23% |
| NR | 29,95% |

Riesgo por exposición



Distribución rating

| | |
|------|--------|
| Cash | 6,25% |
| AAA | 2,62% |
| A | 15,11% |
| BBB | 45,86% |
| BB | 2,09% |
| NR | 28,08% |

Distribución vencimientos

| | |
|------------------|--------|
| Cash | 6,25% |
| <1 año | 36,57% |
| Entre 1 y 2 años | 15,55% |
| Entre 2 y 3 años | 6,59% |
| Entre 3 y 5 años | 6,97% |

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 | 4.880 | Valor liquidativo | 17,65 EUR |
| Inversión mínima | 0,00 | Beneficiarios | 72 | Patrimonio | 3.803.727,56 EUR |