

TREA CONSERVADOR, P.P. (N0231)

RENDA FIJA MIXTA EURO

31 de Octubre 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

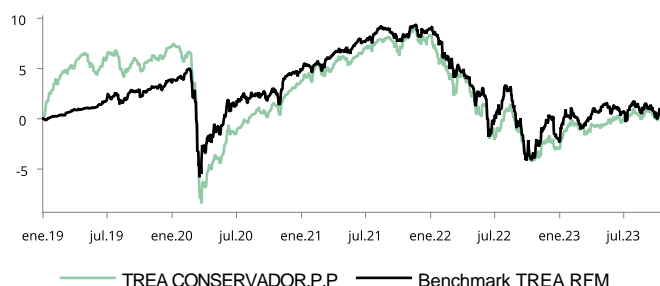
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector 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	-0,62	-0,45	--	--	2,82
Índice	2,40	-0,70	1,11	0,75	-0,26	-0,20	1,03	-0,19	-0,96	-0,18	--	--	2,80
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	-0,45	-0,18
Rentabilidad últimos 3 meses	-1,18	-1,33
Rentabilidad del año	2,82	2,80
Rentabilidad desde creación	120,69	0,44
Rentabilidad anualizada	3,90	0,01
Volatilidad anualizada	3,15	0,04
Ratio de Sharpe	1,05	0,71
Ratio de información	0,08	--
Duración	1,25 años	
Tir	4,38%	
Rating	A-	
Número de posiciones	29	

Mayores pesos Cartera Renta Fija

	19,06% del fondo
CABKSM 4 5/8 05/16/27	6,45%
DANBNK 1 5/8 03/15/24	6,32%
CAIXAB 1 3/8 04/10/24	6,29%

Mayores pesos Cartera Renta Variable

	14,27% del fondo
Fidelity Funds - Global Technology A	8,35%
Valentum FI	4,96%
Airbus Group NV (FR)	0,96%

Distribución por sectores

Cash	9,87%
Financiero	45,22%
Fondos	13,31%
Comunicaciones	10,12%
Gobierno	10,10%
Energía	6,28%
Industrial	2,60%
Utilities	0,95%
Consumo No Ciclico	0,79%
Recursos Basicos	0,77%

Distribución geográfica

Cash	9,87%
España	35,08%
Francia	9,03%
Luxemburgo	8,35%
Otros	37,67%

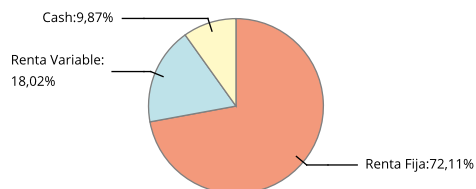
Distribución por divisas

EUR	96,99%
USD	3,01%
CHF	0,00%
Otros	0,00%

Distribución cartera RF

Corporativa	90,15%
Gobierno	9,85%
--	--
Investment Grade	100,00%

Riesgo por exposición



Distribución rating

Cash	9,87%
AAA	8,57%
AA	9,60%
A	17,35%
BBB	37,92%
BB	0,41%

Distribución vencimientos

Cash	9,87%
<1 año	34,79%
Entre 1 y 2 años	23,68%
Entre 2 y 3 años	9,65%
>7 años	3,98%

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	4.747	Valor liquidativo	17,79 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	54	Patrimonio	3.167.251,77 EUR