

TREA HORIZONTE, P.P. (N1051)

RENDA FIJA EURO

31 de Octubre de 2023

Objetivo de inversión

El Fondo de Pensiones invertirá mayoritariamente en activos de renta fija a medio/largo plazo de la Zona Euro, incluidos depósitos a la vista e instrumentos del mercado monetario. La renta fija podrá ser pública y privada, de emisores de países de la OCDE con un rating mínimo de P-3/A3 para el corto plazo y Baa3/BBB- para el largo plazo y en el caso en que se produzcan bajadas sobrevenidas de rating, las posiciones afectadas se podrán mantener en cartera. Las inversiones podrán hacerse a través de contado, derivados y/o IIC's. Los activos estarán denominados en euros, con un máximo del 10% en moneda no euro. La duración media de la cartera será superior a 2 años, salvo que las circunstancias de mercado aconsejen lo contrario.

Gestor

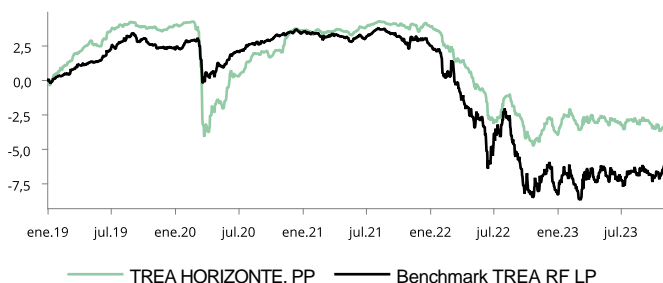
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector 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	1,34	-0,82	0,51	0,21	-0,01	-0,50	0,41	0,18	-0,67	0,02	--	--	0,67
Índice	1,34	-1,34	1,42	0,33	0,30	-0,85	0,74	0,39	-0,79	0,69	--	--	2,21
Fondo 2022	-0,53	-1,16	-0,68	-1,22	-0,89	-2,49	1,89	-1,05	-1,86	-0,10	1,21	-0,84	-7,54
Índice	-0,73	-1,19	-1,65	-1,57	-0,57	-1,45	2,45	-3,27	-2,32	0,07	1,04	-1,76	-10,53
Fondo 2021	-0,32	-0,03	0,27	-0,03	-0,02	0,34	0,31	-0,11	-0,10	-0,22	-0,20	0,33	0,24
Índice	-0,08	-0,44	0,25	-0,14	-0,03	0,10	0,54	-0,21	-0,34	-0,80	0,64	-0,42	-0,95
Fondo 2020	0,19	-0,48	-6,81	2,09	0,84	0,81	1,12	0,45	-0,21	0,38	1,50	0,07	-0,34
Índice	0,64	-0,06	-2,29	0,77	0,23	0,62	0,48	-0,01	0,28	0,40	0,18	0,02	1,24
Fondo 2019	--	0,63	0,65	0,78	-0,33	1,09	0,39	0,22	-0,32	0,00	-0,22	0,33	4,04
Índice	--	0,05	0,69	0,16	0,16	0,76	0,61	0,54	-0,38	-0,37	-0,25	-0,14	2,23
Fondo 2018	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,75
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,38

Tipo de partícipe a quien se dirige y perfil de riesgo

Gráfico del fondo



Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	0,02	0,69
Rentabilidad últimos 3 meses	-0,47	0,28
Rentabilidad del año	0,67	2,21
Rentabilidad desde creación	-99,08	-6,24
Rentabilidad anualizada	-3,99	-0,25
Volatilidad anualizada	2,18	0,04
Ratio de Sharpe	0,54	0,38
Ratio de información	-0,19	--
Duración	2,02 años	
Tir	3,65%	
Rating	BBB+	
Número de posiciones	14	

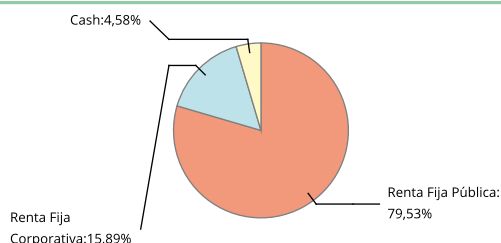
Mayores pesos

	44,21% del fondo
Jupiter JGF Dynamic Bond SICAV	12,77%
Carmignac Securite F EUR ACC	8,18%
RENAUL 0 1/2 07/14/25	7,94%
Evli Nordic Corporate Bond IB	7,73%
SPGB 0 01/31/27	7,59%

Distribución por sectores

Cash	2,29%
Fondos	50,03%
Gobierno	39,74%
Consumo Ciclico	7,94%

Riesgo por exposición



Datos del fondo y el plan

Datos Registrales		Datos Generales		Datos	
Nombre del fondo	TREA RF LP	Gestora	Trea Pensiones	Comisión Gestión	0,85%
Defensor partícipe	PREVIGALIA	Depositaria	CECABANK	Comisión Custodia	0,10%
Fecha de creación	28/12/1998	Nº partícipes	60	Valor liquidativo	11,78 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	1	Patrimonio	592.798,42 EUR