

TREA CRECIMIENTO, P.P. (N2541)

RENDA VARIABLE INTERNACIONAL

31 de Octubre de 2023

Objetivo de inversión

El Fondo de Pensiones invertirá al menos un 75% de su cartera en Renta Variable. El resto del patrimonio podrá estar invertido en activos de renta fija, incluidos depósitos a la vista e instrumentos del mercado monetario. Las inversiones podrán hacerse a través de contado, derivados y/o IIC's. Los valores de renta variable podrán ser tanto nacionales como extranjeros, pudiendo dirigirse las inversiones tanto a países del área euro como fuera de la Unión Monetaria, siempre constituyendo mayoría las inversiones en mercados desarrollados. De forma minoritaria se podrá invertir en mercados emergentes.

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.

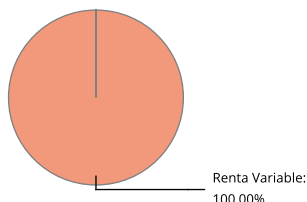
Rendimientos mensuales y anuales (%)

| | Ene | Feb | Mar | Abr | May | Jun | Jul | Ago | Sep | Oct | Nov | Dic | Año |
|-------------------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|--------|
| Fondo 2023 | 11,22 | 0,62 | -2,20 | -0,65 | 1,80 | -0,79 | 2,83 | -1,68 | -1,09 | -3,26 | -- | -- | 6,25 |
| Índice | 4,58 | -0,35 | 0,55 | 0,04 | 1,98 | 2,86 | 1,99 | -0,79 | -1,85 | -2,28 | -- | -- | 6,69 |
| Fondo 2022 | -5,70 | -7,74 | 3,03 | -8,68 | -2,44 | -6,83 | 7,48 | -3,25 | -13,00 | -5,67 | 6,06 | -6,61 | -37,11 |
| Índice | -3,48 | -2,58 | 2,73 | -3,13 | -1,49 | -5,76 | 9,35 | -3,02 | -6,36 | 5,25 | 2,31 | -6,83 | -13,46 |
| Fondo 2021 | -0,44 | 4,38 | 3,90 | 4,51 | -1,24 | 3,32 | 0,55 | 3,73 | -5,23 | 6,54 | -2,83 | 3,86 | 22,38 |
| Índice | -0,30 | 2,10 | 5,54 | 1,72 | -0,26 | 3,86 | 1,56 | 2,36 | -2,19 | 4,74 | 0,49 | 2,60 | 24,31 |
| Fondo 2020 | -1,83 | -9,66 | 2,08 | 5,66 | 3,27 | -1,24 | 4,71 | 7,15 | -5,24 | -4,10 | 12,62 | 3,94 | 16,47 |
| Índice | 0,61 | -6,63 | -11,52 | 9,46 | 2,62 | 1,43 | -0,41 | 4,52 | -1,37 | -2,05 | 8,23 | 1,54 | 4,68 |
| Fondo 2019 | -- | 1,87 | 1,99 | 3,41 | -10,01 | 5,92 | -0,13 | -4,76 | 2,08 | 1,48 | 4,51 | 2,01 | 17,94 |
| Índice | -- | 3,08 | 2,21 | 3,05 | -4,70 | 3,66 | 2,40 | -0,89 | 2,47 | 0,05 | 3,22 | 0,89 | 23,43 |
| Fondo 2018 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 9,61 | -- |
| Índice | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 6,22 | -- |

Estadísticas

| | Fondo (%) | Índice (%) |
|------------------------------|-----------|------------|
| Rentabilidad último mes | -3,26 | -2,28 |
| Rentabilidad últimos 3 meses | -5,92 | -4,85 |
| Rentabilidad del año | 6,25 | 6,69 |
| Rentabilidad desde creación | 75,08 | 49,22 |
| Rentabilidad anualizada | 3,50 | 2,29 |
| Volatilidad anualizada | 13,62 | 0,11 |
| Ratio de Sharpe | 0,40 | 0,17 |
| Ratio de información | 0,45 | -- |
| Beta | 1,00 | -- |
| Número de posiciones | 78 | -- |

Riesgo por exposición



Distribución por divisas

| | |
|-------|--------|
| USD | 63,11% |
| EUR | 19,38% |
| GBP | 7,63% |
| JPY | 1,35% |
| CHF | 1,29% |
| Otros | 8,09% |

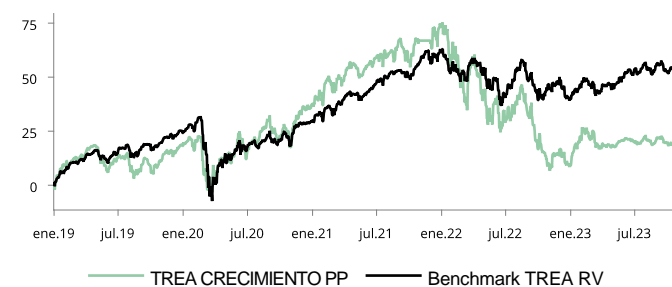
Datos del fondo y el plan

| Datos Registrales | | Datos Generales | | Datos | |
|--------------------|------------|-----------------|----------------|-------------------|------------------|
| Nombre del fondo | TREA RV | Gestora | Trea Pensiones | Comisión Gestión | 1,50% |
| Defensor partícipe | PREVIGALIA | Depositaria | CECABANK | Comisión Custodia | 0,20% |
| Fecha de creación | 11/04/2002 | Nº partícipes | 353 | Valor liquidativo | 16,40 EUR |
| Inversión mínima | 0,00 | Beneficiarios | 18 | Patrimonio | 5.683.196,06 EUR |

Tipo de partícipe a quien se dirige y perfil de riesgo

Adecuado para personas de perfil agresivo que tengan como objetivo de inversión maximizar el capital para la jubilación, invirtiendo íntegramente en renta variable y asumiendo las oscilaciones de la bolsa. Por su carácter arriesgado este Plan de Pensiones es adecuado para personas de edad inferior a los 50 años, con un horizonte muy lejano hasta la jubilación.

Gráfico del fondo



Mayores pesos

| | 14,09% del fondo |
|---------------------------|------------------|
| Berkshire Hathaway /B | 3,41% |
| Alphabet - Class A | 3,10% |
| Microsoft Corp. (USD) | 2,81% |
| Apple Computer Inc. (USD) | 2,56% |
| Amazon.com, Inc. | 2,21% |

Distribución por sectores

| | |
|--------------------|---------|
| Cash | 7,46% |
| Comunicaciones | 20,68% |
| Tecnología | 19,79% |
| Consumo Cíclico | 11,49% |
| Consumo No Cíclico | 11,29% |
| Financiero | 11,12% |
| Industrial | 8,98% |
| Recursos Básicos | 7,19% |
| Energía | 1,81% |
| Otros | -11,62% |

Distribución geográfica

| | |
|----------------|--------|
| Cash | 7,46% |
| Estados Unidos | 50,37% |
| Francia | 8,00% |
| Gran Bretaña | 6,65% |
| Otros | 15,70% |