

TREA TRANQUILIDAD, P.P. (N2872)

RENDA FIJA EURO A CORTO PLAZO

31 de Agosto de 2023

Objetivo de inversión

El Fondo de Pensiones invertirá mayoritariamente en activos de renta fija a corto 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 inferior o igual a 2 años.

Gestor

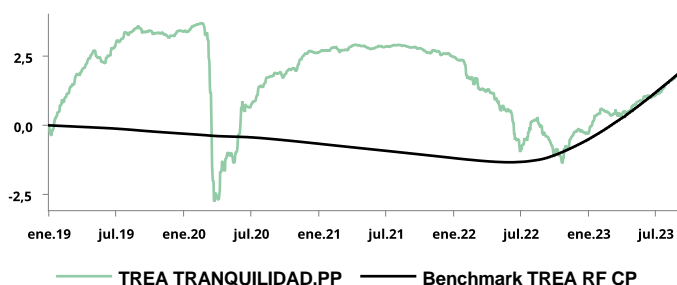
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector 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	0,72	-0,01	-0,01	0,29	0,36	0,02	0,42	0,34	--	--	--	--	2,14
Índice	0,25	0,24	0,28	0,27	0,33	0,31	0,34	0,34	--	--	--	--	2,38
Fondo 2022	-0,26	-0,64	-0,28	-0,42	-0,32	-1,48	1,10	-0,44	-0,78	0,33	0,55	-0,07	-2,71
Índice	-0,04	-0,04	-0,04	-0,02	-0,01	0,01	0,04	0,08	0,13	0,17	0,19	0,21	0,68
Fondo 2021	0,04	-0,04	0,19	0,02	-0,09	0,07	0,05	-0,05	-0,05	-0,18	-0,08	-0,06	-0,18
Índice	-0,04	-0,04	-0,05	-0,04	-0,04	-0,04	-0,04	-0,05	-0,04	-0,04	-0,05	-0,05	-0,52
Fondo 2020	0,23	-0,34	-5,61	1,60	0,63	1,00	0,72	0,40	0,02	0,16	0,63	0,04	-0,70
Índice	-0,03	-0,03	-0,03	-0,02	-0,01	-0,02	-0,03	-0,04	-0,04	-0,04	-0,04	-0,04	-0,36
Fondo 2019	--	0,66	0,55	0,69	-0,38	0,58	0,49	0,22	-0,15	-0,08	-0,10	0,14	3,40
Índice	--	-0,02	-0,02	-0,02	-0,02	-0,03	-0,03	-0,03	-0,03	-0,03	-0,03	-0,03	-0,30
Fondo 2018	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,74	--
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,02	--

Tipo de partícipe a quien se dirige y perfil de riesgo

Gráfico del fondo



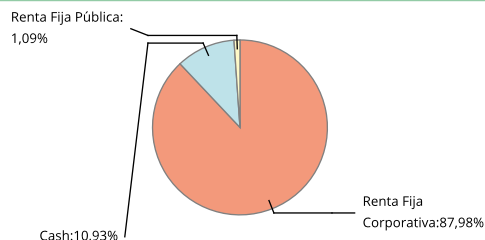
Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	0,34	0,34
Rentabilidad últimos 3 meses	0,78	0,99
Rentabilidad del año	2,14	2,38
Rentabilidad desde creación	1,86	1,85
Rentabilidad anualizada	0,40	0,40
Volatilidad anualizada	0,83	0,00
Ratio de Sharpe	2,78	19,36
Ratio de información	-1,07	--
Duración	0,61 años	
Tir	4,58%	
Rating	BBB+	
Número de posiciones	28	

Mayores pesos

	34,32% del fondo
ITVLN 2 12/01/23	9,23%
F 0 11/15/23	9,17%
CLNXSM 2 7/8 04/18/25	6,78%
RENAUL Float 11/04/24	4,59%
UNIIM 3 03/18/25	4,55%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Cash	10,93%
Financiero	37,64%
Consumo Cíclico	22,86%
Comunicaciones	16,01%
Industrial	6,77%
Titulos Hipotecarios	2,37%
Consumo No Cíclico	2,32%
Gobierno	1,09%

Distribución vencimientos

Cash	10,93%
<6 meses	44,65%
Entre 6 y 12 meses	14,64%
Entre 12 y 18 meses	27,37%
Entre 18 y 24 meses	2,40%

Distribución geográfica

Cash	10,93%
España	20,40%
Italia	15,74%
Estados Unidos	11,47%
Otros	41,46%

Distribución cartera RF

Corporativa	87,98%
Gobierno	1,09%
--	--
Cash	10,94%
Investment Grade	79,88%
High Yield	9,17%

Distribución por divisas

EUR	96,51%
USD	3,49%

Distribución rating

Cash	10,93%
AA	11,57%
A	11,29%
BBB	57,03%
BB	9,17%

Datos del fondo y el plan

Datos Registrales	Datos Generales	Datos
Nombre del fondo	TREA RF CP	Gestora
Defensor partícipe	PREVIGALIA	Trea Pensiones
Fecha de creación	27/09/2002	Depositaria
Inversión mínima	0,00	CECABANK
		Nº partícipes
		Beneficiarios
		Comisión Gestión
		Comisión Custodia
		Valor liquidativo
		Patrimonio

0,75%

0,10%

13,48 EUR

4.374.239,79 EUR