

# TREA TRANQUILIDAD, P.P. (N2872)

## RENDA FIJA EURO A CORTO PLAZO

30 de Abril 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

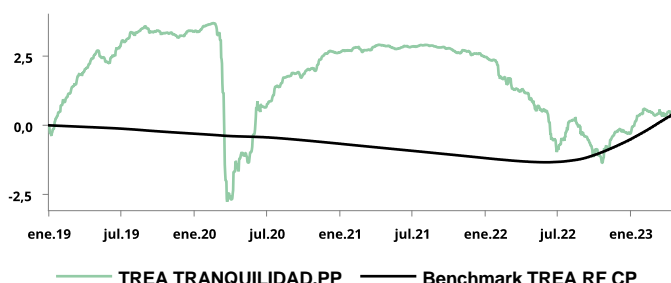
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector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

### Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
<b>Fondo 2023</b>	0,72	-0,01	-0,01	0,29	--	--	--	--	--	--	--	--	0,99
<b>Índice</b>	0,25	0,24	0,28	0,27	--	--	--	--	--	--	--	--	1,04
<b>Fondo 2022</b>	-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
<b>Índice</b>	-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
<b>Fondo 2021</b>	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
<b>Índice</b>	-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
<b>Fondo 2020</b>	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
<b>Índice</b>	-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
<b>Fondo 2019</b>	--	0,66	0,55	0,69	-0,38	0,58	0,49	0,22	-0,15	-0,08	-0,10	0,14	3,40
<b>Índice</b>	--	-0,02	-0,02	-0,02	-0,02	-0,02	-0,03	-0,03	-0,03	-0,03	-0,03	-0,03	-0,30
<b>Fondo 2018</b>	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,74
<b>Índice</b>	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,02

### Tipo de partícipe a quien se dirige y perfil de riesgo

### Gráfico del fondo



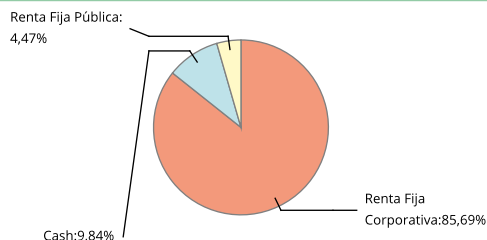
### Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	0,29	0,27
Rentabilidad últimos 3 meses	0,27	0,79
Rentabilidad del año	0,99	1,04
Rentabilidad desde creación	0,71	0,52
Rentabilidad anualizada	0,16	0,12
Volatilidad anualizada	1,16	0,00
Ratio de Sharpe	-0,01	15,26
Ratio de información	-1,72	--
Duración	0,60 años	--
Tir	4,55%	--
Rating	BBB	--
Número de posiciones	26	--

### Mayores pesos

	33,79% del fondo
F 0 11/15/23	9,06%
ITVLN 2 12/01/23	9,00%
CLNXSM 2 7/8 04/18/25	6,65%
NOSPL 1 1/8 05/02/23	4,56%
BKIR 1 3/8 08/29/23	4,52%

### Riesgo por exposición



### Distribución por sectores

Cash	9,84%
Financiero	33,99%
Comunicaciones	22,52%
Consumo Cíclico	22,51%
Industrial	6,67%
Gobierno	4,47%

### Distribución rating

Cash	9,84%
AAA	4,47%
AA	4,48%
A	8,82%
BBB	63,33%
BB	9,06%

### Distribución geográfica

Cash	9,84%
España	17,55%
Italia	16,22%
Estados Unidos	13,61%
Otros	42,78%

### Distribución cartera RF

Corporativa	85,69%
Gobierno	4,47%
--	--
Cash	9,85%
Investment Grade	81,12%
High Yield	9,06%

### Distribución por divisas

EUR	96,66%
USD	3,34%

### Distribución vencimientos

Cash	9,84%
<6 meses	50,25%
Entre 6 y 12 meses	11,19%
Entre 12 y 18 meses	11,19%
Entre 18 y 24 meses	17,53%

### Datos del fondo y el plan

Datos Registrales	Datos Generales	Datos			
Nombre del fondo	TREA RF CP	Gestora	Trea Pensiones	Comisión Gestión	0,75%
Defensor partícipe	PREVIGALIA	Depositaria	CECABANK	Comisión Custodia	0,10%
Fecha de creación	27/09/2002	Nº partícipes	610	Valor liquidativo	13,33 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	27	Patrimonio	4.437.378,17 EUR