

TREA TRANQUILIDAD, P.P. (N2872)

RENDA FIJA EURO A CORTO PLAZO

28 de Febrero 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

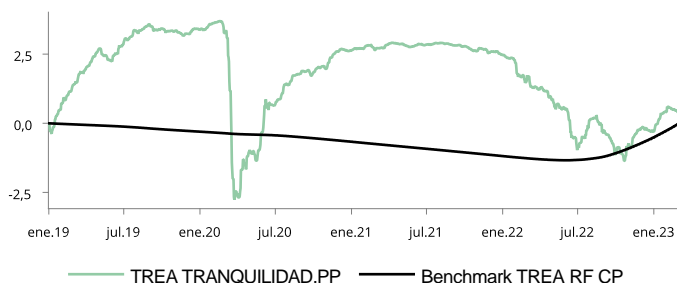
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector 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	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,70
Índice	0,25	0,24	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,49
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	-0,02	-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



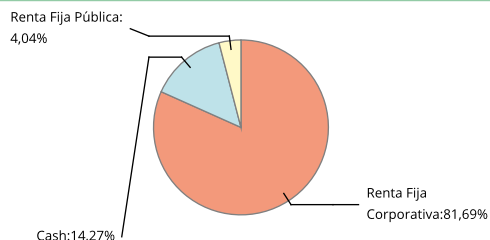
Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	-0,01	0,24
Rentabilidad últimos 3 meses	0,63	0,70
Rentabilidad del año	0,70	0,49
Rentabilidad desde creación	0,42	-0,03
Rentabilidad anualizada	0,10	-0,01
Volatilidad anualizada	1,18	0,00
Ratio de Sharpe	-0,84	12,55
Ratio de información	-2,03	--
Duración	0,68 años	
Tir	4,74%	
Rating	BBB	
Número de posiciones	28	

Mayores pesos

	30,70% del fondo
F 0 11/15/23	8,18%
ITVLN 2 12/01/23	8,15%
CLNXSM 2 7/8 04/18/25	6,13%
NOSPL 1 1/8 05/02/23	4,12%
UNIIM 3 03/18/25	4,12%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Cash	14,27%
Financiero	38,90%
Comunicaciones	20,46%
Consumo Cíclico	16,26%
Gobierno	4,04%
Industrial	4,02%
Consumo No Cíclico	2,06%

Distribución rating

Cash	14,27%
AAA	4,04%
AA	4,03%
A	7,97%
BBB	61,52%
BB	8,18%

Distribución geográfica

Cash	14,27%
Italia	18,81%
España	14,03%
Estados Unidos	10,27%
Otros	42,63%

Distribución cartera RF

Corporativa	81,70%
Gobierno	4,04%
--	--
Cash	14,27%
Investment Grade	77,56%
High Yield	8,18%

Distribución por divisas

EUR	96,87%
USD	3,13%

Distribución vencimientos

Cash	14,27%
<6 meses	47,50%
Entre 6 y 12 meses	10,10%
Entre 12 y 18 meses	12,02%
Entre 18 y 24 meses	16,11%

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	620	Valor liquidativo	13,29 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	28	Patrimonio	4.884.823,51 EUR