

TREA TRANQUILIDAD, P.P. (N2872)

RENDA FIJA EURO A CORTO PLAZO

31 de Octubre 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 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

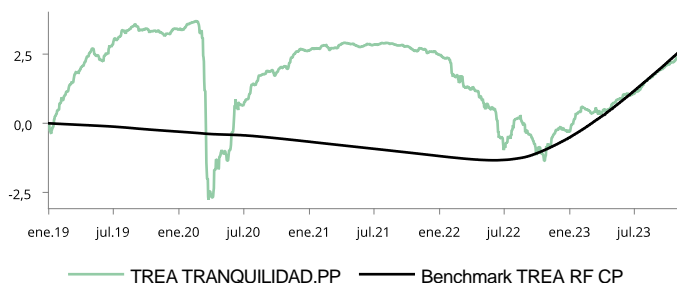
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector 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	0,27	0,31	--	--	2,73
Índice	0,25	0,24	0,28	0,27	0,33	0,31	0,34	0,34	0,32	0,36	--	--	3,08
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	0,31	0,36
Rentabilidad últimos 3 meses	0,92	1,02
Rentabilidad del año	2,73	3,08
Rentabilidad desde creación	35,60	2,55
Rentabilidad anualizada	1,69	0,12
Volatilidad anualizada	0,63	0,00
Ratio de Sharpe	5,35	20,10
Ratio de información	-0,40	--
Duración	0,55 años	--
Tir	4,74%	--
Rating	BBB+	--
Número de posiciones	27	--

Mayores pesos

	36,12% del fondo
ITVLN 2 12/01/23	9,72%
F 0 11/15/23	9,66%
CLNXSM 2 7/8 04/18/25	7,13%
RENAUL Float 11/04/24	4,84%
UNIIM 3 03/18/25	4,77%

Distribución por sectores

Cash	10,26%
Financiero	44,05%
Consumo Cíclico	19,25%
Comunicaciones	16,86%
Industrial	7,14%
Consumo No Cíclico	2,45%

Distribución por divisas

EUR	98,85%
USD	1,15%

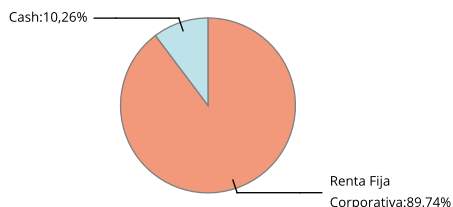
Distribución rating

Cash	10,26%
AA	9,69%
A	11,89%
BBB	68,16%

Distribución cartera RF

Corporativa	89,74%
--	--
Cash	10,26%
Investment Grade	89,73%

Riesgo por exposición



Distribución geográfica

Cash	10,26%
España	23,73%
Italia	15,43%
Gran Bretaña	9,72%
Otros	40,86%

Distribución vencimientos

Cash	10,26%
<6 meses	39,71%
Entre 6 y 12 meses	23,83%
Entre 12 y 18 meses	23,80%
Entre 18 y 24 meses	2,41%

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	580	Valor liquidativo	13,56 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	29	Patrimonio	4.181.338,97 EUR