

TREA TRANQUILIDAD, P.P. (N2872)

RENDA FIJA EURO A CORTO PLAZO

31 de Julio de 2022



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

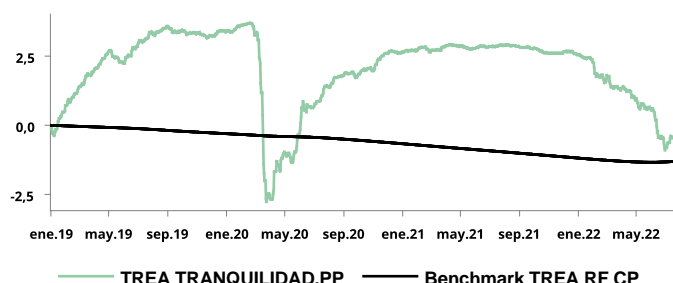
Federico fue director de inversiones en la gestora de Novo Banco. También trabajó gestionando carteras de Renta Fija y Renta Variable en la gestora de Banco Madrid. Anteriormente, trabajó cuatro años en el bróker Intermoney Valores S.V, de grupo CIMD. Los 17 anteriores años los pasó como vicedirector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

Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
Fondo 2022	-0,26	-0,64	-0,28	-0,42	-0,32	-1,48	1,10	--	--	--	--	--	-2,30
Índice	-0,04	-0,04	-0,04	-0,02	-0,01	0,01	0,04	--	--	--	--	--	-0,10
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

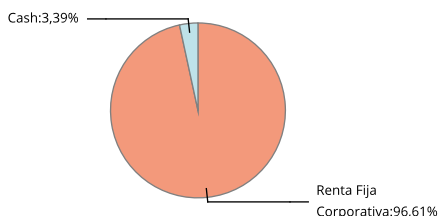
Gráfico del fondo



Estadísticas	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	1,10	0,04
Rentabilidad últimos 3 meses	-0,72	0,04
Rentabilidad del año	-2,30	-0,10
Rentabilidad desde creación	0,14	-1,29
Rentabilidad anualizada	0,04	-0,36
Volatilidad anualizada	0,94	0,00
Ratio de Sharpe	-2,67	-6,87
Ratio de información	-2,56	--
Duración	0,78 años	
Tir	3,39%	
Rating	BBB-	
Número de posiciones	36	

Mayores pesos	29,39% del fondo
ITVLN 2 12/01/23	7,00%
F 0 11/15/23	6,77%
CLNXSM 2 7/8 04/18/25	5,23%
VW 2.7 PERP	5,23%
RENAUL Float 01/12/23	5,16%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Cash	3,39%
Financiero	33,05%
Consumo Cíclico	27,41%
Comunicaciones	17,39%
Utilities	6,90%
Consumo No Cíclico	5,14%
Industrial	3,41%
Energía	1,75%
Inv. Inmobiliarias	1,55%

Distribución vencimientos

Cash	3,39%
<1 año	55,65%
Entre 1 y 2 años	27,41%
Entre 2 y 3 años	12,00%
Entre 3 y 5 años	1,55%

Distribución geográfica

Cash	3,39%
Italia	21,02%
España	17,01%
Francia	13,58%
Otros	44,99%

Distribución cartera RF

Corporativa	96,61%
--	--
Cash	3,39%
Investment Grade	89,86%
High Yield	6,77%

Distribución por divisas

EUR	96,63%
USD	3,37%

Distribución rating

Cash	3,39%
A	8,41%
BBB	81,42%
BB	6,77%

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	681	Valor liquidativo	13,25 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	39	Patrimonio	5.808.099,25 EUR