

VALUE TREE DEFENSIVO, P.P. (N4636)

RENDA VARIABLE MIXTA EURO

28 de Febrero de 2023



Objetivo de inversión

Fondo de Pensiones de Renta Fija Mixta que invertirá un 20% de su exposición total en renta variable y el resto en activos de renta fija, incluidos depósitos a la vista e instrumentos del mercado monetario. Puntualmente el fondo podrá asumir una mayor o menor ponderación a renta variable, aunque nunca superior al 30%. Las inversiones podrán hacerse a través de contado, derivados y/o IIC's. Los activos estarán denominados en euros, con un máximo del 30% en monedas no euro.

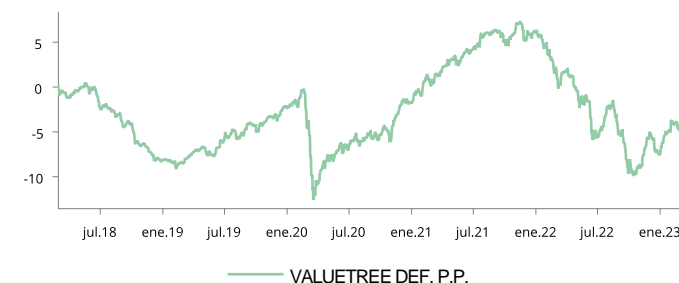
Gestor

Value Tree

Tipo de partícipe a quien se dirige y perfil de riesgo

El fondo se dirige a un perfil de inversor moderado que busque una rentabilidad superior a la que ofrecen los activos más conservadores, a través del plus que ofrece a medio/largo plazo la parte minoritaria en renta variable. Por su carácter moderado este Plan de Pensiones es adecuado para personas de edad en torno a los 50-60 años, con un horizonte amplio hasta la jubilación

Gráfico del fondo



Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
Fondo 2023	2,84	0,15	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	3,00
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2022	-1,39	-2,23	-0,57	-2,03	-0,92	-4,44	3,75	-3,09	-4,62	0,92	3,78	-2,38	-12,83
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2021	0,80	1,15	1,68	1,20	0,19	0,89	1,35	0,52	-1,05	0,91	-0,84	0,91	7,94
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2020	0,11	-2,40	-6,22	3,07	0,80	0,36	0,16	1,34	-0,06	-0,73	4,18	0,36	0,60
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2019	-0,39	-0,03	1,34	0,56	-0,99	1,81	1,26	0,16	0,56	0,32	0,67	0,89	6,30
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
Fondo 2018	--	--	-1,14	0,79	-0,50	-1,47	-0,18	-1,34	-0,51	-2,36	-1,18	-0,60	-8,18
Índice	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	0,15	--
Rentabilidad últimos 3 meses	0,54	--
Rentabilidad del año	3,00	--
Rentabilidad desde creación	16,39	--
Rentabilidad anualizada	1,40	--
Volatilidad anualizada	5,86	--
Ratio de Sharpe	-1,15	--
Ratio de información	--	--
Duración	3,05 años	--
Tir	5,34%	--
Rating	BBB	--
Número de posiciones	58	--

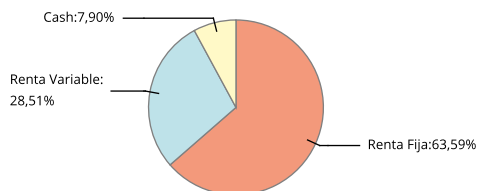
Mayores pesos Cartera Renta Fija

	12,18% del fondo
Part. Muzinich Funds - EnhancedYield HAH	4,62%
ELOFR 2 5/8 01/30/24	3,83%
BRITEL 1 3/4 03/10/26	3,73%

Mayores pesos Cartera Renta Variable

	2,55% del fondo
Renault	0,87%
STMicroelectronics NV (Francia)	0,85%
Technip Energies NV	0,83%

Riesgo por exposición



Distribución rating

Cash	7,90%
AA	1,50%
A	4,85%
BBB	69,14%
BB	0,77%
B	0,67%

Distribución vencimientos

Cash	7,90%
<1 año	3,83%
Entre 1 y 2 años	3,73%
Entre 2 y 3 años	14,59%
Entre 3 y 5 años	27,18%
Entre 5 y 7 años	9,65%

Distribución por sectores

Cash	7,90%
Financiero	26,20%
Consumo No Ciclico	16,94%
Comunicaciones	14,44%
Consumo Ciclico	10,93%
Industrial	5,83%
Energia	5,42%
Fondos	4,62%
Inv. Inmobiliarias	3,71%
Otros	4,01%

Distribución geográfica

Cash	7,90%
Francia	24,07%
Gran Bretaña	19,12%
Estados Unidos	17,89%
Otros	31,01%

Distribución por divisas

EUR	84,22%
USD	9,70%
GBP	2,94%
CHF	2,36%
Otros	0,78%

Distribución cartera RF

Corporativa	100,00%
--	--
Investment Grade	100,00%

Datos del fondo y el plan

Datos Registrales		Datos Generales		Datos	
Nombre del fondo	TREA AHORRO 1	Gestora	Trea Pensiones	Comisión Gestión	1,00%
Defensor partícipe	PREVIGALIA	Depositaria	CECABANK	Comisión Custodia	0,05%
Fecha de creación	26/01/2012	Nº partícipes	49	Valor liquidativo	11,64 EUR
Inversión mínima	0,00	Beneficiarios	6	Patrimonio	2.570.308,49 EUR