

TREA GLOBAL FLEXIBLE 0-35, FI

GLOBAL

28 de Febrero de 2022

Objetivo de inversión

El fondo se gestiona de forma muy flexible y activa con el objetivo de optimizar la relación rentabilidad/riesgo de la cartera, no existiendo un índice de referencia. Se podrá invertir un 0-100% del patrimonio en IIC financieras que sean activo apto, armonizadas o no (máximo 30% en IIC no armonizadas), del grupo o no de la Gestora. Se invertirá, directa o indirectamente, un 0-35% de la exposición total en renta variable, y el resto de la exposición total en renta fija (incluyendo depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, líquidos), divisas y otros instrumentos financieros aptos que permita la normativa en cada momento y de acuerdo a la Directiva 2009/65/CE

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 | -1,38 | -2,57 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -3,92 |
| Índice | -1,21 | -1,67 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -2,86 |
| Fondo 2021 | -0,41 | 1,16 | 2,23 | 0,84 | 0,38 | 0,72 | 0,14 | 0,86 | -0,66 | 0,71 | -1,11 | 1,12 | 6,10 |
| Índice | -0,11 | 0,01 | 1,17 | 0,18 | -0,07 | 0,76 | 0,72 | 0,24 | -0,67 | 0,16 | 0,63 | 0,12 | 3,18 |
| Fondo 2020 | -0,68 | -2,71 | -4,95 | 2,70 | 0,89 | 0,02 | 0,60 | 1,88 | -1,14 | -1,74 | 4,83 | 1,80 | 1,13 |
| Índice | 0,64 | -1,22 | -3,74 | 2,30 | 0,67 | 0,80 | 0,33 | 0,78 | 0,01 | -0,03 | 1,57 | 0,29 | 2,28 |
| Fondo 2019 | -- | 0,89 | 1,02 | 1,79 | -4,99 | 2,97 | -0,02 | -2,59 | 0,33 | 0,07 | 0,74 | 0,38 | 4,86 |
| Índice | -- | 0,58 | 0,96 | 0,67 | -0,70 | 1,27 | 0,93 | 0,31 | 0,12 | -0,29 | 0,36 | 0,05 | 5,76 |
| Fondo 2018 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 4,47 |
| Índice | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 1,40 |

Escala de riesgo

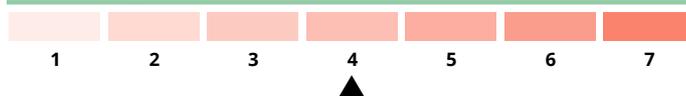


Gráfico del fondo



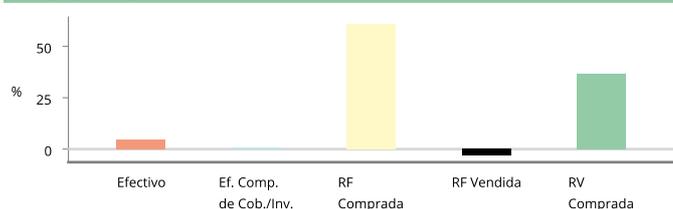
Estadísticas

| | Fondo (%) | Índice (%) |
|------------------------------|-----------|------------|
| Rentabilidad último mes | -2,57 | -1,67 |
| Rentabilidad últimos 3 meses | -2,84 | -2,75 |
| Rentabilidad del año | -3,92 | -2,86 |
| Rentabilidad desde creación | 8,10 | 8,41 |
| Rentabilidad anualizada | 2,56 | 2,66 |
| Volatilidad anualizada | 4,84 | 0,02 |
| Ratio de Sharpe | 0,28 | 0,19 |
| Ratio de información | 0,27 | -- |
| Duración | 0,80 años | |
| Tir | 3,44% | |
| Rating | BBB | |
| Número de posiciones | 132 | |

Mayores pesos

| | 10,32% del fondo |
|-----------------------|------------------|
| Berkshire Hathaway /B | 2,17% |
| Amazon.com, Inc. | 2,07% |
| Alphabet - Class A | 2,05% |
| META PLATFORMS INC | 2,03% |
| IDRSM 3 04/19/24 | 2,00% |

Riesgo por exposición



*Efectivo comprometido de Cobertura e Inversión.

Distribución rating

| | |
|------|--------|
| Cash | 4,66% |
| AAA | 1,32% |
| AA | 5,00% |
| A | 17,33% |
| BBB | 29,61% |
| BB | 14,11% |
| B | 3,09% |
| NR | 24,86% |

Distribución cartera RF

| | |
|------------------|--------|
| Corporativa | 59,21% |
| Gobierno | 1,91% |
| -- | -- |
| Cash | 4,64% |
| Investment Grade | 41,68% |
| High Yield | 16,52% |
| NR | 2,00% |

Distribución por sectores

| | |
|--------------------|--------|
| Cash | 4,66% |
| Financiero | 31,00% |
| Consumo Cíclico | 12,33% |
| Comunicaciones | 11,40% |
| Tecnología | 10,12% |
| Consumo No Cíclico | 8,32% |
| Industrial | 6,03% |
| Utilities | 5,89% |
| Energía | 4,05% |
| Otros | 8,43% |

Distribución geográfica

| | |
|----------------|--------|
| Cash | 4,66% |
| Estados Unidos | 27,09% |
| España | 18,23% |
| Francia | 12,88% |
| Otros | 39,37% |

Distribución por divisas

| | |
|-------|--------|
| EUR | 78,15% |
| USD | 17,85% |
| CHF | 1,09% |
| GBP | 0,72% |
| Otros | 2,19% |

Distribución vencimientos

| | |
|------------------|--------|
| Cash | 4,66% |
| <1 año | 33,03% |
| Entre 1 y 2 años | 15,94% |
| Entre 2 y 3 años | 3,27% |
| Entre 3 y 5 años | 7,00% |
| >7 años | 0,98% |

Datos del fondo

| Datos Registrales | |
|-------------------|-------------------|
| Código ISIN | ES0137942001 |
| Bloomberg | -- |
| Fecha de creación | 20/04/2007 |
| Nombre del gestor | Federico Battaner |

| Datos Generales | |
|-----------------|----------------------|
| Gestora | TREA ASSET MANAGEMEN |
| Depositaria | CECABANK |
| Auditor | BAILEN 20, S.A.P. |

| Datos | |
|-------------------|-------------------|
| Comisión Gestión | 1,20% |
| Comisión Custodia | 0,05% |
| Valor liquidativo | 13,19 EUR |
| Patrimonio | 52.883.382,84 EUR |