

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

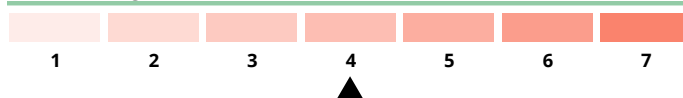
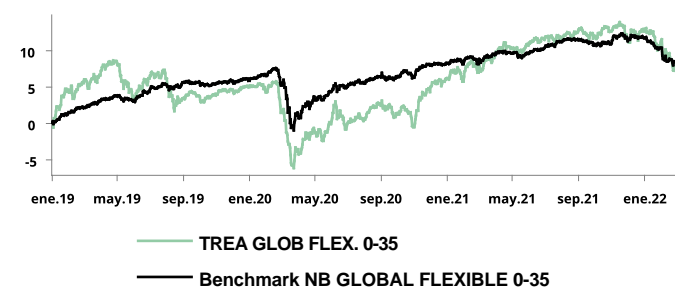


Gráfico del fondo



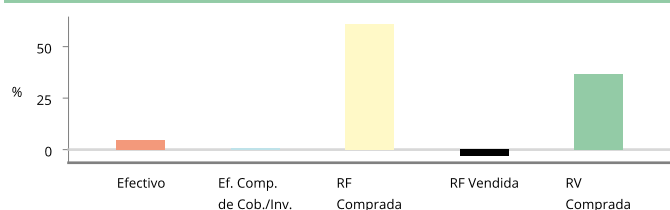
Estadísticas

	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