

TREA GLOBAL FLEXIBLE 0-35, FI

GLOBAL

30 de Junio 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	1,09	-2,03	-1,33	-4,24	--	--	--	--	--	--	-10,09
Índice	-1,21	-1,42	-0,87	-1,83	-0,71	-2,20	--	--	--	--	--	--	-7,98
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

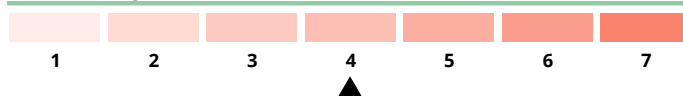
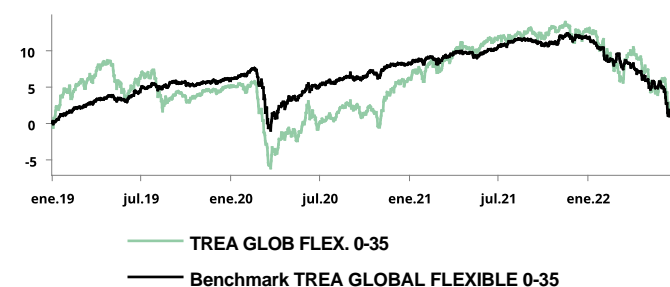


Gráfico del fondo



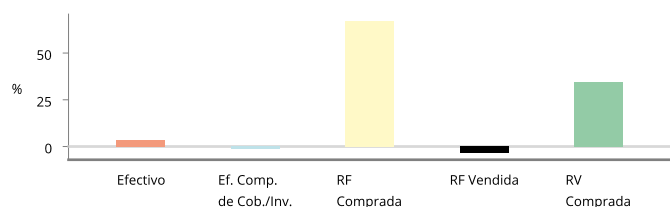
Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	-4,24	-2,20
Rentabilidad últimos 3 meses	-7,43	-4,68
Rentabilidad del año	-10,09	-7,98
Rentabilidad desde creación	1,16	2,70
Rentabilidad anualizada	0,33	0,77
Volatilidad anualizada	6,60	0,04
Ratio de Sharpe	-1,37	-1,70
Ratio de información	-0,46	--
Duración	0,64 años	
Tir	8,89%	
Rating	BBB	
Número de posiciones	117	

Mayores pesos

	11,37% del fondo
IAGLN 0 5/8 11/17/22	2,35%
C Float 09/01/23	2,27%
GS Float 02/23/23	2,27%
SANTAN 1 PERP	2,24%
ISLBAN 0 3/4 03/25/25	2,24%

Riesgo por exposición



*Efectivo comprometido de Cobertura e Inversión.

Distribución rating

Cash	3,39%
AAA	1,46%
AA	4,58%
A	17,83%
BBB	31,98%
BB	15,95%
B	3,52%
NR	21,29%

Distribución cartera RF

Corporativa	65,51%
Gobierno	1,78%
--	--
Cash	3,40%
Investment Grade	45,34%
High Yield	19,26%
NR	0,72%

Distribución por sectores

Cash	3,39%
Financiero	34,53%
Consumo Cíclico	14,32%
Comunicaciones	10,68%
Tecnología	8,05%
Consumo No Cíclico	7,16%
Utilities	6,34%
Industrial	5,72%
Derivados	5,04%
Otros	9,81%

Distribución geográfica

Cash	3,39%
Estados Unidos	24,32%
España	19,45%
Francia	14,73%
Otros	43,15%

Distribución por divisas

EUR	83,04%
USD	13,44%
CHF	0,99%
GBP	0,00%
Otros	2,53%

Distribución vencimientos

Cash	3,39%
<1 año	41,51%
Entre 1 y 2 años	12,75%
Entre 2 y 3 años	4,48%
Entre 3 y 5 años	5,91%
>7 años	0,64%

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	DELOITTE,S.L

Datos	
Comisión Gestión	1,20%
Comisión Custodia	0,05%
Valor liquidativo	12,34 EUR
Patrimonio	42.035.879,18 EUR