

Objetivo de inversión

Fondo de renta fija euro que invertirá en activos de renta fija pública y/o privada, incluidos depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, que sean líquidos. Al menos un 75% de la cartera tendrá un rating igual o superior a la del Reino de España o Investment Grade. Hasta un 25% de la cartera podrá estar invertido en activos con rating inferior, con un mínimo de B-. La duración media de la cartera será superior a un año, aunque normalmente oscilará entre 2 y 5 años.

Gestor

Ascensión Gómez, es la gestora principal del fondo y líder del equipo de Renta Fija de Trea Capital. Aporta 20 años de experiencia y es la responsable de la selección de valores.

Rendimientos mensuales y anuales (%)

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
Fondo 2023	1,63	-0,53	0,15	0,23	--	--	--	--	--	--	--	--	1,47
Índice	2,09	-1,62	1,30	0,65	--	--	--	--	--	--	--	--	2,40
Fondo 2022	-0,91	-2,00	-0,96	-1,87	-1,05	-3,14	2,84	-2,20	-2,49	0,20	1,43	-0,88	-10,64
Índice	-1,40	-2,74	-1,36	-2,92	-1,26	-3,42	5,00	-4,59	-3,37	0,16	2,83	-1,97	-14,43
Fondo 2021	-0,12	-0,29	0,12	0,06	-0,06	-0,05	0,57	-0,24	-0,35	-0,67	0,11	-0,18	-1,11
Índice	-0,22	-0,90	0,10	-0,02	-0,19	0,45	1,23	-0,47	-0,72	-0,72	0,18	-0,12	-1,40
Fondo 2020	0,32	-0,36	-4,30	1,55	0,32	0,84	0,72	0,20	-0,01	0,14	0,44	-0,04	-0,29
Índice	1,27	-0,42	-7,04	4,31	0,07	1,27	1,58	0,04	0,33	0,85	0,89	0,08	2,89
Fondo 2019	0,71	0,56	0,74	0,68	-0,40	0,91	0,55	0,23	-0,44	-0,12	-0,17	0,08	3,36
Índice	1,09	0,71	1,44	0,65	-0,13	1,60	1,49	0,61	-0,90	-0,19	-0,36	-0,12	6,00
Fondo 2018	--	--	--	--	-1,17	-0,29	0,33	-0,26	-0,27	-0,41	-0,97	0,03	-2,96
Índice	--	--	--	--	-0,21	0,08	0,19	0,03	-0,32	-0,12	-0,60	0,24	-0,72

Escala de riesgo

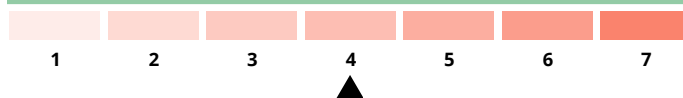
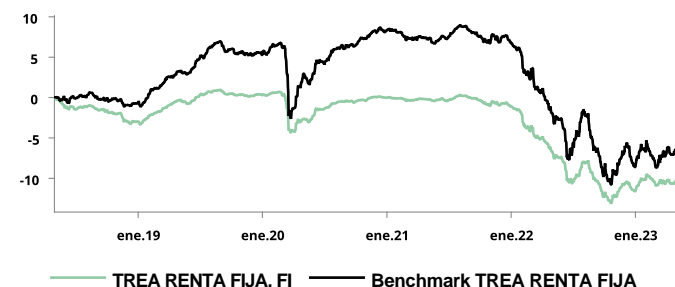


Gráfico del fondo



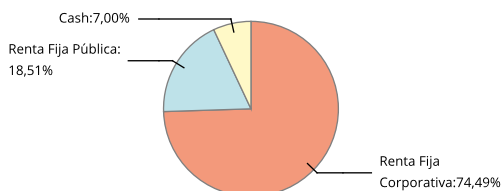
Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	0,23	0,65
Rentabilidad últimos 3 meses	-0,15	0,30
Rentabilidad del año	1,47	2,40
Rentabilidad desde creación	-10,31	-6,44
Rentabilidad anualizada	-2,06	-1,29
Volatilidad anualizada	3,48	0,07
Ratio de Sharpe	-1,09	-0,68
Ratio de información	0,16	--
Duración	2,67 años	
Tir	5,13%	
Rating	BBB+	
Número de posiciones	115	

Mayores pesos

	13,28% del fondo
T 1 1/4 06/30/28	4,06%
SPGB 0.7 04/30/32	2,97%
SPGB 3.15 04/30/33	2,53%
ISPIM 5 03/08/28	1,95%
EEFT 1 3/8 05/22/26	1,77%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Cash	7,00%
Financiero	41,25%
Gobierno	18,51%
Comunicaciones	8,16%
Consumo No Cíclico	7,16%
Utilities	6,01%
Consumo Cíclico	5,90%
Industrial	2,36%
Recursos Basicos	1,85%
Otros	1,81%

Distribución rating

Cash	7,00%
AAA	6,39%
AA	1,75%
A	22,89%
BBB	47,42%
BB	11,74%
B	2,81%

Distribución geográfica

Cash	7,00%
España	29,25%
Estados Unidos	10,40%
Italia	8,59%
Otros	44,76%

Distribución vencimientos

Cash	7,00%
<1 año	23,37%
Entre 1 y 2 años	13,10%
Entre 2 y 3 años	20,48%
Entre 3 y 5 años	22,06%
Entre 5 y 7 años	5,93%
>7 años	8,06%

Distribución por divisas

EUR	92,46%
USD	7,54%

Distribución cartera RF

Corporativa	74,50%
Gobierno	18,51%
--	--
Cash	7,00%
Investment Grade	78,40%
High Yield	14,56%

Datos del fondo

Datos Registrales

Código ISIN	ES0168662031
Bloomberg	FONPSRF SM Equity
Fecha de creación	24/03/1999
Nombre del gestor	Ascensión Gómez

Datos Generales

Gestora	TREA ASSET MANAGEMENT
Depositaria	CECABANK
Auditor	DELOITTE,S,L

Datos

Comisión Gestión	1,20%
Comisión Custodia	0,05%
Valor liquidativo	98,81 EUR
Patrimonio	15.528.393,48 EUR