

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	0,59	-0,28	--	--	--	--	--	--	1,79
Índice	2,09	-1,62	1,30	0,65	0,15	-0,47	--	--	--	--	--	--	2,08
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	--	--	--	--	--	--	0,33	-0,26	-0,27	-0,41	-0,97	0,03	-1,53
Índice	--	--	--	--	--	--	0,19	0,03	-0,32	-0,12	-0,60	0,24	-0,58

Escala de riesgo

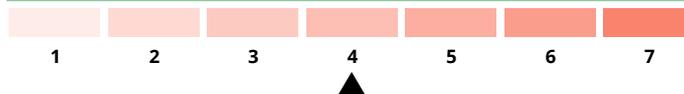
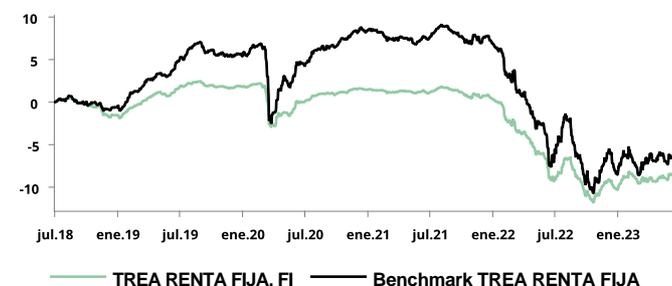


Gráfico del fondo



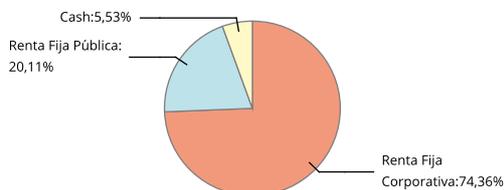
Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	-0,28	-0,47
Rentabilidad últimos 3 meses	0,54	0,33
Rentabilidad del año	1,79	2,08
Rentabilidad desde creación	-8,71	-6,62
Rentabilidad anualizada	-1,74	-1,32
Volatilidad anualizada	3,26	0,06
Ratio de Sharpe	0,22	-0,02
Ratio de información	0,21	--
Duración	3,10 años	
Tir	4,99%	
Rating	BBB+	
Número de posiciones	120	

Mayores pesos

	13,56% del fondo
T 1 1/4 06/30/28	4,09%
SPGB 0.7 04/30/32	3,05%
SPGB 3.15 04/30/33	2,61%
ISPIM 5 03/08/28	2,01%
EEFT 1 3/8 05/22/26	1,80%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Sector	Porcentaje
Cash	5,53%
Financiero	43,43%
Gobierno	20,11%
Consumo Cíclico	7,41%
Consumo No Cíclico	7,21%
Comunicaciones	7,15%
Utilities	5,53%
Industrial	2,36%
Recursos Basicos	0,70%
Inv. Inmobiliarias	0,57%

Distribución geográfica

País	Porcentaje
Cash	5,53%
España	33,23%
Estados Unidos	11,33%
Italia	9,55%
Otros	40,36%

Distribución por divisas

Divisa	Porcentaje
EUR	92,17%
USD	7,83%

Distribución cartera RF

Categoría	Porcentaje
Corporativa	74,36%
Gobierno	20,11%
--	--
Cash	5,53%
Investment Grade	80,63%
High Yield	13,80%

Distribución rating

Rating	Porcentaje
Cash	5,53%
AAA	6,48%
AA	1,78%
A	24,14%
BBB	48,28%
BB	11,42%
B	2,38%

Distribución vencimientos

Vencimiento	Porcentaje
Cash	5,53%
<1 año	17,41%
Entre 1 y 2 años	16,24%
Entre 2 y 3 años	20,65%
Entre 3 y 5 años	24,02%
Entre 5 y 7 años	9,04%
>7 años	7,11%

Datos del fondo

Datos Registrales		Datos Generales		Datos	
Código ISIN	ES0168662031	Gestora	TREA ASSET MANAGEMEN	Comisión Gestión	1,20%
Bloomberg	FONPSRF SM Equity	Depositaria	CECABANK	Comisión Custodia	0,05%
Fecha de creación	24/03/1999	Auditor	DELOITTE,S.L	Valor liquidativo	99,11 EUR
Nombre del gestor	Ascensión Gómez			Patrimonio	15.125.864,83 EUR