

TREA RENTA FIJA, FI

RENDA FIJA EURO

31 de Julio de 2023

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	0,80	--	--	--	--	--	2,60
Índice	1,34	-1,34	1,42	0,33	0,30	-0,85	0,74	--	--	--	--	--	1,92
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	--	--	--	--	--	--	--	-0,26	-0,27	-0,41	-0,97	0,03	-1,86
Índice	--	--	--	--	--	--	--	0,03	-0,32	-0,12	-0,60	0,24	-0,77

Escala de riesgo

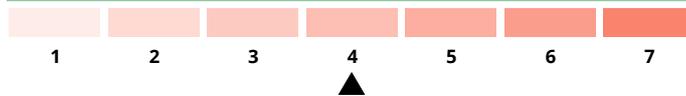
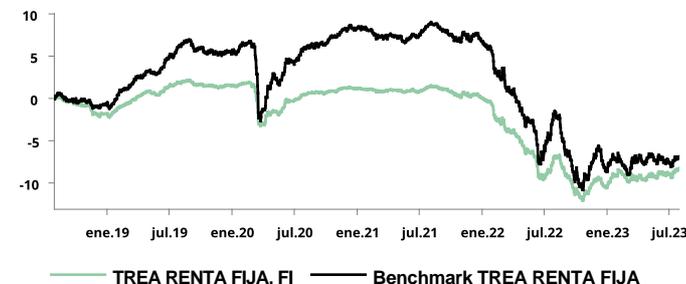


Gráfico del fondo



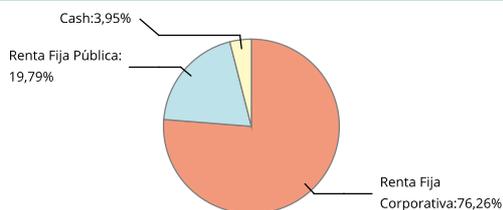
Estadísticas

	Fondo (%)	Índice (%)
Rentabilidad último mes	0,80	0,74
Rentabilidad últimos 3 meses	1,11	0,19
Rentabilidad del año	2,60	1,92
Rentabilidad desde creación	-8,28	-6,93
Rentabilidad anualizada	-1,66	-1,39
Volatilidad anualizada	3,12	0,05
Ratio de Sharpe	-0,41	-0,95
Ratio de información	1,35	--
Duración	3,08 años	
Tir	4,96%	
Rating	BBB+	
Número de posiciones	119	

Mayores pesos

	13,84% del fondo
T 1 1/4 06/30/28	4,14%
SPGB 0.7 04/30/32	3,11%
SPGB 3.15 04/30/33	2,65%
ISPIM 5 03/08/28	2,09%
EEFT 1 3/8 05/22/26	1,85%

Riesgo por exposición



Distribución por sectores

Cash	3,95%
Financiero	45,51%
Gobierno	19,79%
Consumo Cíclico	8,11%
Consumo No Cíclico	7,43%
Utilities	6,38%
Comunicaciones	4,28%
Industrial	2,42%
Energía	0,95%
Otros	1,17%

Distribución rating

Cash	3,95%
AAA	6,57%
AA	1,83%
A	24,66%
BBB	49,11%
BB	10,30%
B	3,57%

Distribución geográfica

Cash	3,95%
España	34,63%
Estados Unidos	11,54%
Italia	9,85%
Otros	40,03%

Distribución vencimientos

Cash	3,95%
<1 año	17,79%
Entre 1 y 2 años	19,48%
Entre 2 y 3 años	19,17%
Entre 3 y 5 años	22,79%
Entre 5 y 7 años	9,29%
>7 años	7,54%

Distribución por divisas

EUR	92,03%
USD	7,97%

Distribución cartera RF

Corporativa	76,26%
Gobierno	19,79%
--	--
Cash	3,94%
Investment Grade	82,18%
High Yield	13,88%

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 MANAGEMEN
Depositaria CECABANK
Auditor DELOITTE,S.L

Datos

Comisión Gestión 1,20%
Comisión Custodia 0,05%
Valor liquidativo 99,90 EUR
Patrimonio 14.827.565,03 EUR