ADRIZA RENTA FIJA CORTO PLAZO RESPONSABLE, FI

31 de diciembre de 2024

Perfil de Riesgo 2 sobre 7

Características

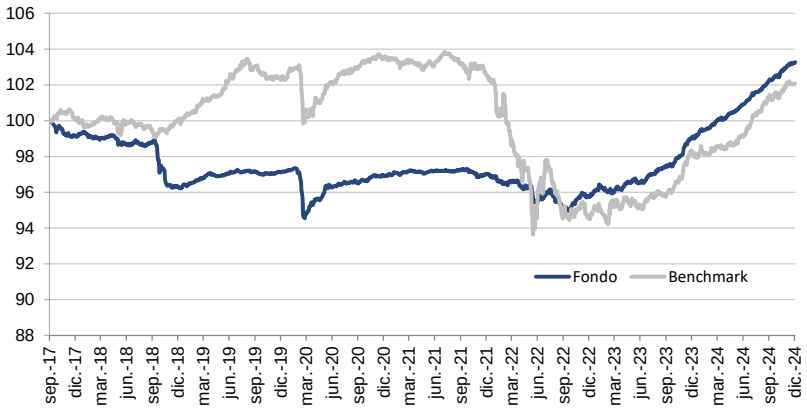
Divisa base:	Euro
Rating Morningstar:	★★
Fecha de inicio:	29 de septiembre de 2017
Código ISIN / Bloomberg Ticker:	ES0119376004 / ARFCPLR SM
Depositario:	Banco Inversis
Gestora:	Tressis Gestión SGIIC
Benchmark:	100% H02109EU Index
Horizonte temporal recomendado:	3 años

Política de inversión

La gestión toma como referencia la rentabilidad del índice Euribor a 3 meses, siendo su objetivo máximo de volatilidad anual inferior al 2,0%. El fondo invertirá el 100% de la exposición total en renta fija, tanto pública como privada de emisores y/o mercados de países de la OCDE, fundamentalmente del área euro. No obstante, su exposición en países emergentes y en otras divisas diferentes al euro, podrá alcanzar hasta un máximo del 10%. Su duración media se situará entre seis y doce meses, mientras que la vencimiento medio de la cartera no superará los dieciocho meses.

Rentabilidad y patrimonio

Valor liquidativo actual:		103,27 €
Rentabilidad del mes (diciembre):		0,27%
Patrimonio:		80.827.685 €
Rentabilidades:	YTD	4,24%
	3 meses	1,01%
	12 meses	4,24%
	3 años	6,46%
	5 años	6,35%
	Desde inicio	3,27%
Rentabilidades anuales:	2023	3,48%
	2022	-1,30%
	2021	0,11%
	2020	-0,21%
	2019	0,84%
	2018	-2,86%
	2017	-
	2016	-



Datos estadísticos

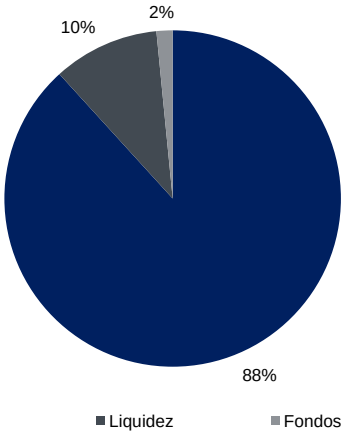
Volatilidad anualizada (12M):	0,51%		
Ratio de Sharpe:	2,19		
Ratio Información 1 año:	4,02		
% Meses Ganadores 3 años:	75,0%		
Mes de mayor ganancia:	0,74%	*diciembre 2023*	
Mes de mayor pérdida:	-0,97%	*junio 2022*	

VaR no correlacionado. Estándar 1,65 σ (95%) 1 año

VaR Total Cartera 95% 1 año	2,65%
VaR Total Cartera 99% 1 mes	1,29%
VaR Tipo Interés	2,15%
VaR Crédito	0,99%
VaR Bolsa	0,00%
VaR Divisa	0,71%
VaR Fondos	0,00%

Distribución por activos

Clase de activo	Categoría	Valoración	%
Liquidez	Liquidez	8.231.947	10,2%
	Subtotal liquidez	8.231.947	10,2%
Renta Fija	Bonos cupón cero	28.670.612	35,5%
	Bonos cupón fijo	36.216.982	44,8%
	Bonos flotantes	2.445.485	3,0%
	Bonos estructurados	3.997.670	4,9%
	Subtotal renta fija	71.330.749	88,3%
Renta Variable	Renta variable (directa)	-	-
	Subtotal renta variable	-	-
Fondos	Renta variable	-	-
	Renta fija	1.249.275	1,5%
	Mixtos	-	-
	Mercado monetario	-	-
	Alternativos	-	-
	Convertibles	-	-
	Subtotal fondos	1.249.275	1,5%
Derivados	Renta variable	-	-
	Renta fija -	8.581.942	-10,6%
	Subtotal derivados -	8.581.942	-10,6%



Mayores posiciones	Valoración	%
Rbc Investor Services	8.231.947,10	10,18%
Spain, Kingdom Of (Government)	7.902.360,33	9,78%
United States Treasury	4.090.974,75	5,06%
Netherlands, Kingdom Of The (Government)	1.830.535,07	2,26%
Caixabank Sa	1.551.927,05	1,92%
Resto	57.227.890,06	70,80%

Distribución por sector	Valoración	%
Otros Servicios Financieros	22.988.127,25	28,44%
Tesoro	17.748.940,13	21,96%
Bancos y Cajas	8.290.376,73	10,26%
Construcción e Inmobiliarias	7.688.738,57	9,51%
Industria	6.289.123,23	7,78%
Resto	17.830.328,44	22,06%

Datos del Fondo

Compra mínima:	Inicial:	€10

Comisiones anuales:	Gestión:	0,50%
	Depósito:	0,06%

El presente documento no presta asesoramiento financiero personalizado. Ha sido elaborado con independencia de las circunstancias y objetivos financieros particulares de las personas que lo reciben. El inversor que tenga acceso al presente documento debe ser consciente de que los valores, instrumentos o inversiones a que el mismo se refiere pueden no ser adecuados para sus objetivos específicos de inversión, su posición financiera o su perfil de riesgo ya que éstas no han sido tomadas en cuenta para la elaboración del presente informe. Este documento tiene carácter exclusivamente informativo y no debe ser considerado ni utilizado como una oferta de suscripción de Fondos de Inversión de ningún tipo. Cualquier decisión de un inversor para adquirir participaciones en el Fondo debe realizarse exclusivamente sobre la base de los términos incorporados en el correspondiente Folleto registrado en la CNMV disponible tanto en la CNMV, y Sociedad Rectora del Mercado correspondiente, así como a través de las entidades comercializadoras. Este documento ha sido preparado utilizando fuentes de información consideradas fiables. Sin embargo, no se garantiza la exactitud ni el carácter completo de la información, ni se asume responsabilidad alguna al respecto. Los datos sobre retorno pro forma de los Fondos no esta auditada. El retorno total de los Fondos está sujeto a fluctuaciones de los mercados de acciones, bonos y materias primas así como tipos de cambio. Rendimientos pasados no son garantía o proyecciones de rendimientos futuros. Las opiniones y previsiones aquí reflejadas pueden no ser compartidas por todos los empleados de Tressis Gestión, SGIIC, SA. y pueden ser modificadas sin previo aviso.