

Características	
Divisa base:	Euro
Rating Morningstar:	-
Fecha de inicio:	2 de diciembre de 2022
Código ISIN / Bloomberg Ticker:	ES0180682066 / -
Depositario:	Banco Inversis
Gestora:	Tressis Gestión SGIC
Benchmark:	50% LBEATREU & 35% NDEEWNR & 15% M7EU

Política de inversión

La gestión toma como referencia la rentabilidad del índice 50% Bloomberg Euro Aggregate Total Return Index Value Unhedged EUR + 35% MSCI All Countries World Index Net Total Return EUR + 15% MSCI Europe Net Total Return Index, sujeto a un objetivo de volatilidad máxima inferior al 10% anual. Se invierte 50-100% del patrimonio en IIC financieras (activo apto), armonizadas o no (máximo 30% en IIC no armonizadas), del grupo o no de la Gestora.

Rentabilidad y patrimonio	
Valor liquidativo actual:	11,98 €
Rentabilidad del mes (diciembre):	-0,77%
Patrimonio:	21.040.475 €
Rentabilidades:	
YTD	12,63%
3 meses	3,31%
12 meses	12,63%
3 años	-
5 años	-
Desde inicio	19,78%
Rentabilidades anuales:	
2023	7,58%
2022	-1,14%
2021	-
2020	-
2019	-
2018	-
2017	-
2016	-

Datos estadísticos	
Volatilidad anualizada (12M):	6,04%
Ratio de Sharpe:	1,57
Ratio Información 1 año:	1,58
% Meses Ganadores 3 años:	70,8%
Mes de mayor ganancia:	4,50% <i>noviembre 2023</i>
Mes de mayor pérdida:	-2,17% <i>octubre 2023</i>
VaR Total Cartera 95% 1 año	13,15%
VaR Total Cartera 99% 1 mes	6,42%
VaR Tipo Interés	3,33%
VaR Crédito	0,72%
VaR Bolsa	12,68%
VaR Divisa	5,39%
VaR Fondos	0,58%

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

Distribución por activos			
Clase de activo	Categoría	Valoración	%
Liquidez	Liquidez	195.012	0,9%
	<i>Subtotal liquidez</i>	195.012	0,9%
Renta Fija	Bonos cupón cero	-	-
	Bonos cupón fijo	-	-
	Bonos flotantes	-	-
	Bonos estructurados	-	-
	<i>Subtotal renta fija</i>	-	-
Renta Variable	Renta variable (directa)	-	-
	<i>Subtotal renta variable</i>	-	-
Fondos	Renta variable	13.589.750	64,6%
	Renta fija	7.136.893	33,9%
	Mixtos	-	-
	Mercado monetario	-	-
	Alternativos	-	-
	Convertibles	-	-
	<i>Subtotal fondos</i>	20.726.642	98,5%
Derivados	Renta variable	-	-9,8%
	Renta fija	-	-
	<i>Subtotal derivados</i>	-	-9,8%

Mayores posiciones	Valoración	%
Fil Fund Management (Ireland) Ltd	2.021.302,47	9,61%
Amundi Luxembourg Sa	1.911.296,39	9,08%
Invesco Management Sa	1.830.062,50	8,70%
Vanguard Group (Ireland) Limited	1.701.963,79	8,09%
Mfs Investment Management Company Lux S	1.570.240,94	7,46%
Resto	12.005.608,99	57,06%

Distribución por sector	Valoración	%
Fondo	20.726.642,22	98,51%
Bancos y Cajas	206.222,83	0,98%
RESTO	118.820,63	0,56%
Liquidez	-	-0,05%
-	-	-
Resto	-	-

Datos del Fondo	
Compra mínima:	Inicial: €10
Comisiones anuales:	Gestión: 1,65%
	Depósito: 0,08%

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, SGIC, SA. y pueden ser modificadas sin previo aviso.