

RENTA FIJA LARGO PLAZO
JUNIO 2018
Objetivo y Política de Inversión

Plan de Pensiones del Sistema Individual integrado en el fondo de pensiones Arquidos Inversión FP. La vocación inversora del fondo se define como un fondo de Renta Fija Largo Plazo. El objetivo del fondo es proporcionar al participante, con un horizonte de inversión de medio/largo plazo una rentabilidad adecuada al riesgo asumido, invirtiendo con los máximos criterios de seguridad y rentabilidad, mediante la inversión diversificada en fondos y activos de renta fija mundial, en función de la legislación vigente. La gestión de las inversiones del Fondo buscará alcanzar la máxima rentabilidad dentro de una adecuada distribución y compensación de riesgos.

El fondo se caracterizará por invertir un mínimo del 50% de su patrimonio en otras IIC financieras, que sean activo apto, armonizadas o no, pertenecientes o no al grupo de la gestora, que inviertan tanto en renta fija pública y privada, gestión alternativa, etc. El resto de la exposición total será en activos de renta fija publica/privada (incluyendo depósitos e instrumentos del mercado monetario cotizados o no, que sean líquidos), o gestión alternativa. No existe predeterminación respecto a los emisores (público o privado, rating o sector económico), ni sobre la duración de los activos de renta fija y la exposición a riesgo divisa. Los activos no tendrán un nivel de calificación crediticia mínima. Para materializar el patrimonio del Fondo de pensiones, se utilizan activos aptos para la inversión conforme la legislación vigente (en la actualidad el Real Decreto 304/2004 de 20 de febrero, por el que se aprueba el Reglamento de planes y fondos de pensiones). El Fondo, podrá operar con instrumentos financieros derivados negociados en mercados organizados con la finalidad de cobertura y como inversión, según el artículo 71 del Reglamento de Pensiones aprobado por RD 304/2004.

Rentabilidad 5 años


Arquiplan Inversión PP

15,7%

Análisis de Rentabilidad

	1 mes	3 meses	6 meses	1 año	2 años	3 años	5 años	Inicio
Arquiplan Inversión PP	-0,62	-0,85	-1,22	-0,77	-0,92	5,25	15,71	25,97

Fecha de rentabilidad: 30/06/2018

Características

Entidad Gestora	Arquipensiones EGFP
Depositario	Arquipensiones
Categoría	Renta fija Largo Plazo - PP
Estrellas Morningstar	★★★★
Fondo de Pensiones	Arquidos Inversión FP
Código DGS Fondo	F0739
Fecha Creación	27/07/2000
Patrimonio	5.003.813,00
Valor Liquidativo	7,57 €
Inversión Mínima	30
C.Gestión	0,80
C. Depósito	—
web Gestora	http://www.arquipensiones.es

Perfil de Riesgo

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Evolucion de 10.000 euros en 2 años


Arquiplan Inversión PP

9.907,6 — Euribor 12 Month EUR

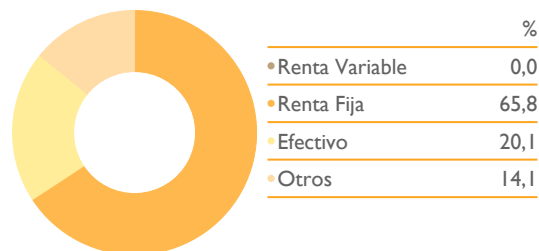
9.985,7

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2018	0,25	-0,15	-0,47	0,35	-0,58	-0,62							—
2017	-0,32	0,18	0,11	0,21	0,17	0,09	0,05	0,00	-0,01	0,34	0,01	0,06	0,89
2016	0,66	-0,11	0,68	-0,08	0,30	0,91	0,14	0,11	0,15	-0,48	-1,34	0,85	1,76
2015	0,59	1,23	0,42	-1,34	-1,82	-2,50	2,74	-1,05	0,85	1,45	0,53	-0,75	0,21
2014	1,81	0,78	1,01	0,89	0,59	0,99	0,53	1,25	0,36	0,04	0,54	0,59	9,80
2013	1,06	0,82	0,23	3,91	-0,77	-1,30	0,72	0,55	1,12	1,36	-0,11	0,01	7,76

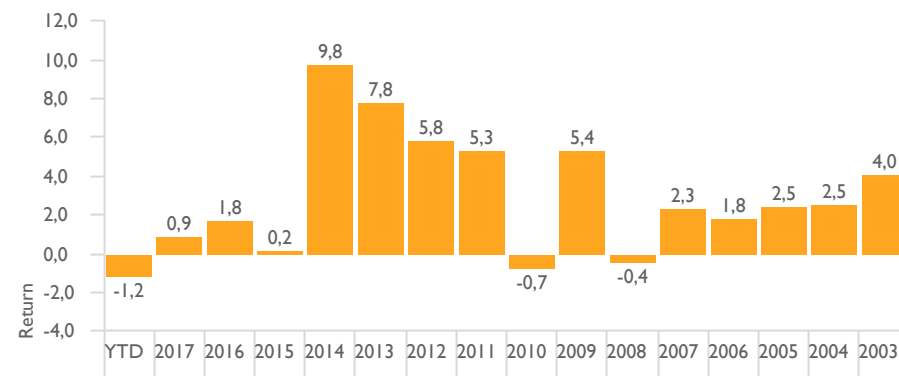
Estadísticas

	1 año	3 años
Rentabilidad	-0,77	1,72
Volatilidad	1,15	2,68
Beta	0,93	0,92
Correlation	0,93	0,93
Ratio Sharpe	-0,02	0,29
Max Drawdown	-1,63	-2,12
Value at Risk	0,12	0,27
Meses Positivo	7	24
Meses Negativos	5	12

Distribución de activos



Calendario de Rentabilidades



RENTA FIJA

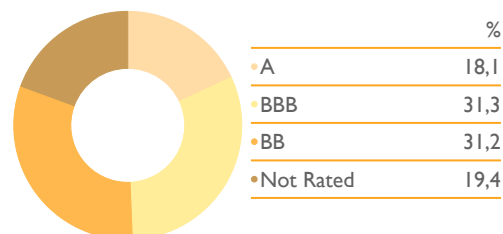
Distribución Sector Renta Fija

Bonos Gobierno	21,39
Bonos Municipales	0,00
Deuda Corporativa	57,50
Titulaciones	0,75
Derivados	1,96
Liquidez & Repo	18,40

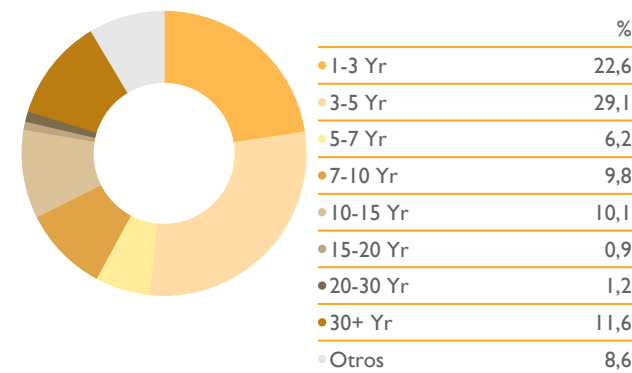
Duración Renta fija

Duración	—
Vencimiento	—
Calidad Crediticia	BB

Distribución Calidad Crediticia



Distribución Vencimientos



10 Principales Posiciones

	Peso %
Futuro Bono Español 10 Yr 0918 Koa08	-9,34
General Motors Financial Company Inc	8,62
Italy (Republic Of)	7,18
Credit Suisse Group Funding (Guernsey) Limited	6,52
Long-Term Euro-BTP Futures Sept18	-5,45
Spain (Kingdom of) 0.65%	4,76
Societe Generale S.A. 6.75%	4,65
Caixabank S.A.	4,58
Koninklijke KPN N.V. 6.12%	4,54
Banco Santander, S.A. 6.25%	4,54

Distribución Renta Fija País

