

RENTA FIJA CORTO PLAZO

DICIEMBRE 2018

Objetivo y Política de Inversión

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

El Fondo invertirá el 100% en renta fija, pública o privada, no tendrá exposición a renta variable y la duración media de la cartera no excederá los 3 años, pudiendo ser de hasta 2 años negativos. No existe predeterminación respecto a los emisores (público o privado, rating o sector económico). Si alguna emisión no ha sido calificada, se tendrá en cuenta la calificación crediticia del emisor. Podrá invertir, en valores de renta fija negociados fuera de la OCDE y hasta un 25% en mercados emergentes. Como mínimo el 75% del patrimonio serán activos de renta fija con Grado de Inversión, el resto podrá ser de baja calificación crediticia o sin calificación. La inversión en divisa distinta al euro no superará el 10% del patrimonio. Dentro de la renta fija, además de valores se incluyen depósitos a la vista o con vencimiento inferior a un año en entidades de crédito e instrumentos del mercado monetario que sean líquidos. Se podrá invertir un máximo del 20% en IIC financieras que sean activos aptos, armonizadas o no, pertenecientes o no al Grupo de la Gestora y con una política de inversión coherente con la del fondo. El Fondo, podrá operar con instrumentos financieros derivados negociados en mercados organizados con la finalidad de cobertura y como inversión.

Rentabilidad 5 años



Arquiplan Monetario PP

-1,2%

Análisis de Rentabilidad

| | 1 mes | 3 meses | 6 meses | 1 año | 2 años | 3 años | 5 años | Inicio |
|------------------------|-------|---------|---------|-------|--------|--------|--------|--------|
| Arquiplan Monetario PP | -0,21 | -1,53 | -1,42 | -2,13 | -1,92 | -2,11 | -1,20 | 28,97 |

Fecha de rentabilidad: 31/12/2018

ARQUIGEST Sociedad Gestora de Instituciones de Inversión Colectiva S. A. Inscrita con el nº 36, en el Reg. de Entidades Gestoras de Instituciones de Inversión Colectiva de la Comisión Nacional de Mercado de Valores. C.I.F. A-58073388. Reg. Mercantil de Ba. Este documento no constituye una oferta o recomendación para la adquisición o venta, o para realizar cualquier transacción. Ninguna información contenida en el presente informe debe interpretarse como asesoramiento o consejo y debe considerarse como opiniones.

Fuente: Morningstar Direct

Características

| | |
|-----------------------|---|
| Entidad Gestora | Arquipensiones EGFP |
| Depositario | Arquipensiones |
| Categoría | Renta Fija Corto Plazo - PP |
| Estrellas Morningstar | ★★★ |
| Fondo de Pensiones | Arquidos Monetario FP |
| Código DGS Fondo | F0848 |
| Fecha Creación | 22/11/2001 |
| Patrimonio | 18.251.444,00 |
| Valor Liquidativo | 7,75 € |
| Inversión Mínima | 30 |
| C.Gestión | 0,50 |
| web Gestora | http://www.arquipensiones.es |

Perfil de Riesgo



Evolucion de 10.000 euros en 2 años



Arquiplan Monetario PP

9.807,5 — Euribor 12 Month EUR

9.971,3

| | Ene | Feb | Mar | Abr | May | Jun | Jul | Ago | Sep | Oct | Nov | Dic | Año |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2018 | 0,13 | -0,10 | -0,11 | 0,02 | -0,61 | -0,04 | 0,20 | -0,19 | 0,10 | -0,34 | -0,98 | -0,21 | -2,13 |
| 2017 | -0,11 | 0,01 | -0,07 | 0,05 | -0,04 | 0,02 | 0,07 | -0,10 | 0,15 | 0,22 | -0,06 | 0,05 | 0,21 |
| 2016 | 0,06 | -0,04 | -0,03 | 0,02 | -0,02 | -0,02 | -0,04 | -0,05 | -0,05 | -0,10 | -0,13 | 0,21 | -0,19 |
| 2015 | 0,14 | 0,08 | 0,02 | -0,07 | -0,05 | -0,21 | 0,17 | -0,13 | -0,04 | 0,06 | 0,05 | -0,13 | -0,11 |
| 2014 | 0,50 | 0,17 | 0,11 | 0,05 | 0,05 | 0,21 | 0,08 | 0,05 | -0,02 | -0,16 | 0,06 | -0,08 | 1,04 |

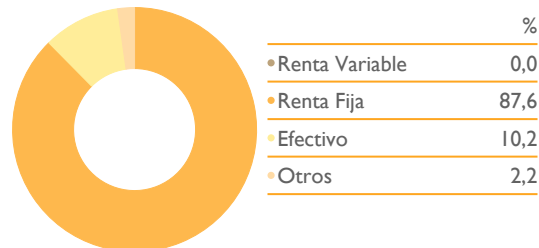
RENTA FIJA CORTO PLAZO

DICIEMBRE 2018

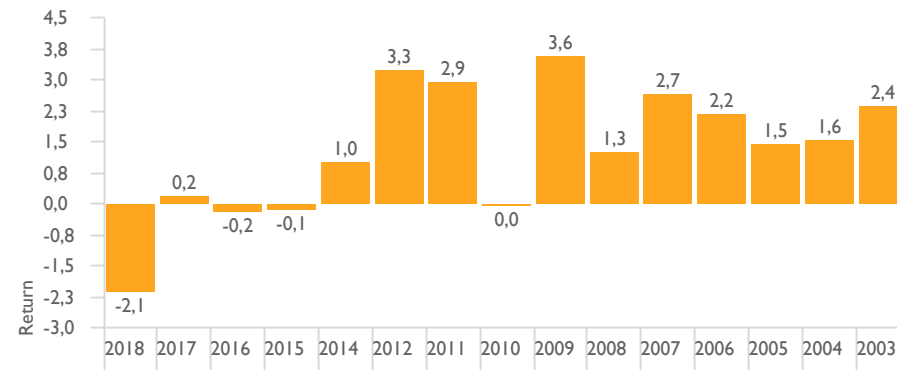
Estadísticas

| | 1 año | 3 años |
|-----------------|-------|--------|
| Rentabilidad | -2,13 | -0,71 |
| Volatilidad | 0,75 | 0,55 |
| Beta | 0,84 | 0,87 |
| Correlation | 0,91 | 0,94 |
| Ratio Sharpe | -1,71 | -0,06 |
| Max Drawdown | -2,40 | -2,40 |
| Value at Risk | 0,08 | 0,06 |
| Meses Positivo | 4 | 14 |
| Meses Negativos | 8 | 22 |

Distribución de activos



Calendario de Rentabilidades



RENTA FIJA

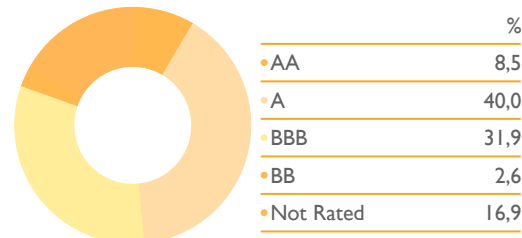
Distribución Sector Renta Fija

| | |
|-------------------|-------|
| Bonos Gobierno | 12,59 |
| Bonos Municipales | 0,00 |
| Deuda Corporativa | 77,22 |
| Titulaciones | 0,00 |
| Derivados | 0,00 |
| Liquidez & Repo | 10,19 |

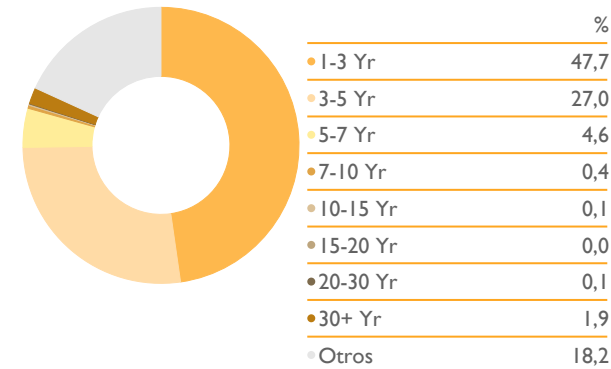
Duración Renta fija

| | |
|--------------------|------|
| Duración | — |
| Vencimiento | 0,97 |
| Calidad Crediticia | BB |

Distribución Calidad Crediticia



Distribución Vencimientos



10 Principales Posiciones

| | Peso % |
|---|--------|
| Credit Suisse Group Funding (Guernsey) Limited | 6,36 |
| Acciona Sa 0% | 5,57 |
| Italy (Republic Of) | 5,57 |
| Deutsche Bank AG | 4,60 |
| Saudacor - Sociedade Gestora de Recursos e Equipamentos da Saude dos Acores | 3,92 |
| Banco Santander, S.A. | 3,22 |
| Italy (Republic Of) | 2,85 |
| Acciona Financiacion Filiales S.A. Unipersonal | 2,79 |
| UBS Group Funding (Switzerland) AG | 2,75 |
| Morgan Stanley | 2,74 |

Distribución Renta Fija País

