

RENTA FIJA CORTO PLAZO
ENERO 2020
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 participante, 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

1,3%

Análisis de Rentabilidad

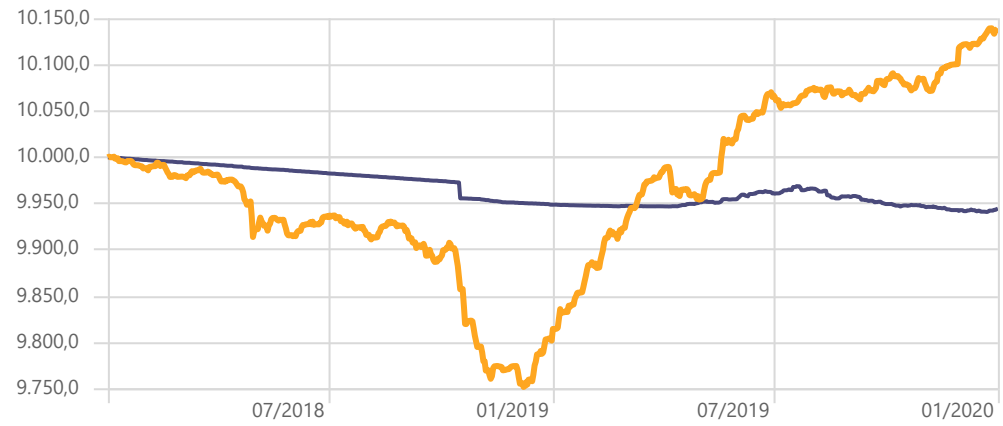
	1 mes	3 meses	6 meses	1 año	2 años	3 años	5 años	Inicio
Arquiplan Monetario PP	0,19	0,56	0,72	3,30	1,39	1,85	1,28	33,78

Fecha de rentabilidad: 31/01/2020

Características

Entidad Gestora	Arquipensiones EGFP
Depositario	Arquia Bank, S.A.
Categoría	Renta Fija Corto Plazo - PP
Estrellas Morningstar	★★★★
Fondo de Pensiones	Arquidos Monetario FP
Código DGS Fondo	F0848
Fecha creación	22/11/2001
Patrimonio	18.456.913,00
Valor liquidativo	8,04 €
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

10.139,0

Euribor 12 Month EUR

9.944,7

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2020	0,19												0,19
2019	0,41	0,65	0,46	0,61	-0,30	0,65	0,47	0,07	-0,03	0,12	0,02	0,35	3,53
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

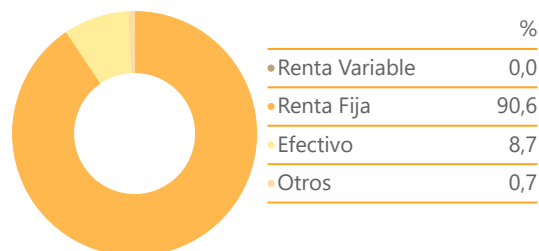
RENTA FIJA CORTO PLAZO

ENERO 2020

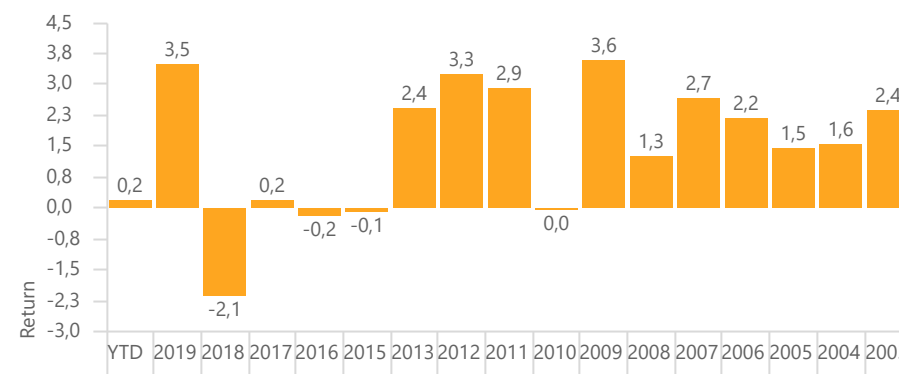
Estadísticas

	1 año	3 años
Rentabilidad	3,30	0,61
Volatilidad	0,71	0,68
Beta	0,82	0,86
Correlation	0,87	0,92
Ratio Sharpe	-0,67	-0,09
Max Drawdown	-0,35	-2,48
Value at Risk	0,06	0,07
Meses Positivo	10	22
Meses Negativos	2	14

Distribución de Activos



Calendario de Rentabilidades



RENTA FIJA

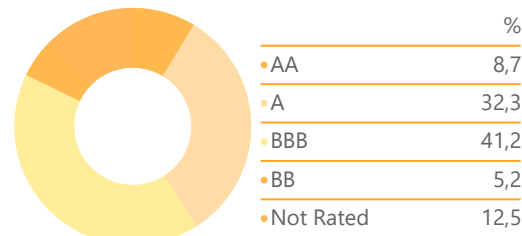
Distribución Sector Renta Fija

Bonos Gobierno	10,49
Bonos Municipales	0,00
Deuda Corporativa	80,76
Titulaciones	0,00
Derivados	0,02
Liquidez & Repo	8,73

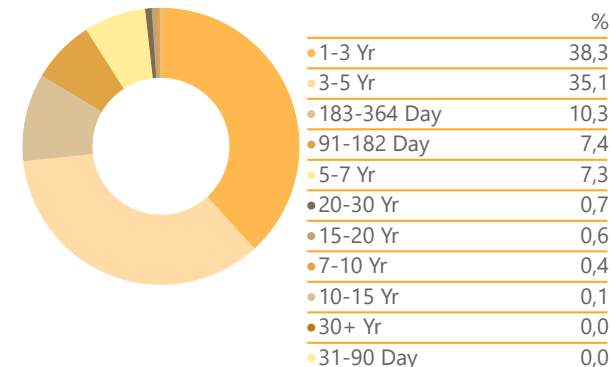
Duración Renta Fija

Duración	1,01
Vencimiento	—
Calidad Crediticia	BB

Distribución Calidad Crediticia



Distribución Vencimientos



10 Principales Posiciones

	Peso %
Credit Suisse Group Funding (Guernsey) Limited	7,41
Italy (Republic Of)	6,42
Banco Santander, S.A.	3,88
Morgan Stanley	3,22
HSBC Holdings plc	3,22
UBS Group AG	3,22
Acciona Financiacion Filiales S.A. Unipersonal 0.56%	3,21
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A.	3,21
Volkswagen Leasing GmbH	3,20
RCI Banque S.A.	3,15

Distribución Renta Fija País

