

RENTA VARIABLE
JUNIO 2020
Objetivo y Política de Inversión

Plan de Pensiones del Sistema Individual integrado en el fondo de pensiones Arquidos Bolsa FP. La vocación inversora del fondo se define como un fondo de Renta Variable. El objetivo del fondo es proporcionar al partícipe, con un horizonte de inversión de largo plazo una rentabilidad adecuada al riesgo asumido, invirtiendo con los máximos criterios de seguridad y rentabilidad, mediante la inversión diversificada en activos de renta variable principalmente europeos, 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 invertirá como mínimo un 75% de su cartera en Renta Variable, principalmente en valores europeos, pudiendo invertir también en mercado norteamericano y hasta un 10% en mercados emergentes. Al menos el 60% de la inversión total estará invertida en valores emitidos por entidades en Europa y el resto podrá invertirse en otros emisores y/o mercados organizados. No se establecen limitaciones respecto a la capitalización o los sectores. 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 resto de la inversión del fondo estará en activos de Renta Fija, tanto pública como privada, principalmente de emisores denominados en Euros y en mercados europeos. Dentro de la renta fija, además se incluyen depósitos en entidades de crédito e instrumentos del mercado monetario que sean líquidos y negociados o no en mercados organizados. La inversión en divisa distinta al euro no superará el 30% del patrimonio. 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 Bolsa PP

-7,8%

Análisis de Rentabilidad

	1 mes	3 meses	6 meses	1 año	2 años	3 años	5 años	Inicio
Arquiplan Bolsa PP	3,15	15,95	-9,76	-4,62	-8,33	-7,97	-7,78	-3,49

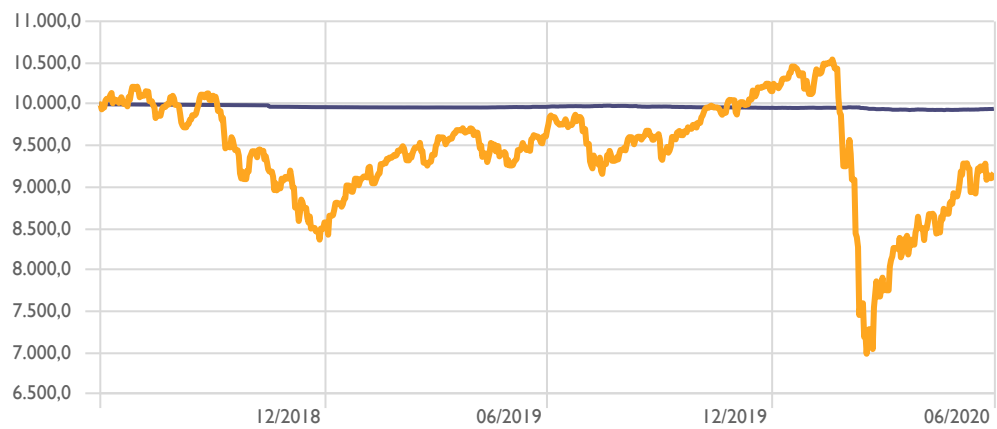
Fecha de rentabilidad: 30/06/2020

Fuente: Morningstar Direct

Características

Entidad Gestora	Arquipensiones EGFP
Depositario	Arquia Bank, S.A.
Categoría	Renta Variable - PP
Estrellas Morningstar	★★
Fondo de Pensiones	Arquidos Bolsa FP
Código DGS Fondo	F0740
Fecha creación	27/07/2000
Patrimonio	4.829.936,00
Valor liquidativo	5,80 €
Inversión mínima	30
C.Gestión	1,40
web Gestora	http://www.arquipensiones.es

Perfil de Riesgo

Evolucion de 10.000 euros en 2 años


Arquiplan Bolsa PP

9.167,2 — Euribor 12 Month EUR

9.945,2

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Año
2020	-0,34	-8,63	-14,54	7,95	4,14	3,15							-9,76
2019	6,26	3,05	0,03	3,39	-4,60	3,78	0,79	-2,46	2,01	0,82	3,40	1,09	18,50
2018	3,04	-3,95	-1,47	5,26	-0,96	-1,15	2,13	-2,16	0,59	-6,89	-2,71	-5,84	-13,85
2017	-0,78	1,63	2,38	0,58	0,68	-2,42	-0,51	-0,75	2,58	2,21	-2,80	-0,73	1,91
2016	-5,51	-2,43	2,48	1,36	1,59	-3,87	3,90	1,04	0,08	1,73	0,03	4,75	4,75
2015	5,38	6,45	2,59	-1,01	-0,47	-4,14	2,89	-8,51	-4,57	9,18	1,85	-6,12	1,93

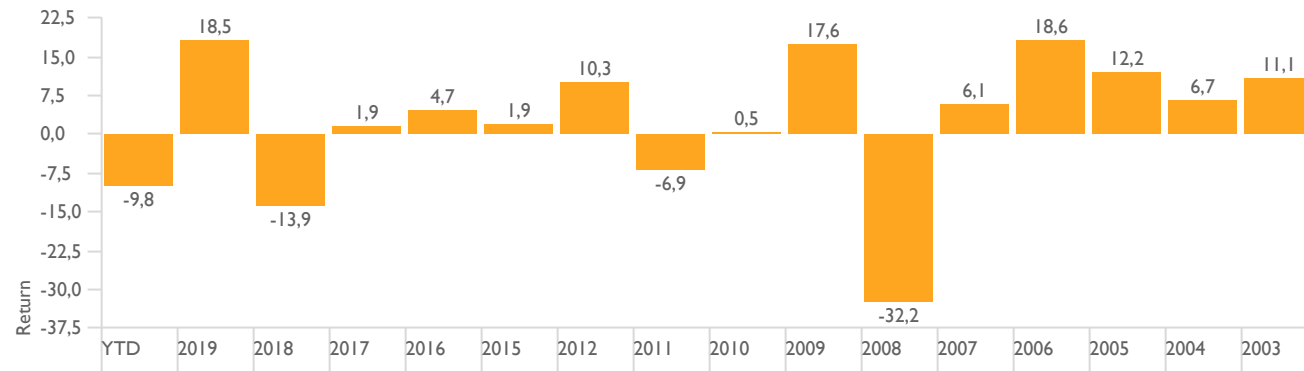
RENTA VARIABLE

JUNIO 2020

Estadísticas

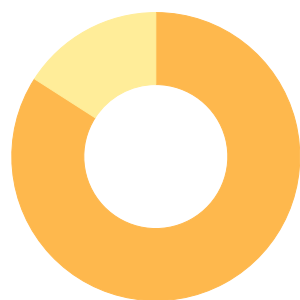
	1 año	3 años
Rentabilidad	-4,61	-2,73
Volatilidad	27,41	19,28
Beta	1,95	1,57
Correlation	0,76	0,70
Ratio Sharpe	-0,25	-0,28
Max Drawdown	-33,72	-33,72
Value at Risk	2,74	1,93
Meses Positivo	8	19
Meses Negativos	4	17

Calendario de Rentabilidades



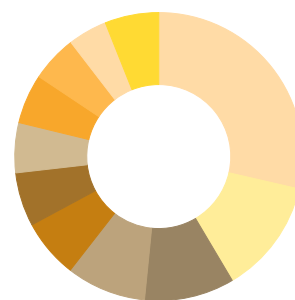
RENTA VARIABLE

Distribución de Activos



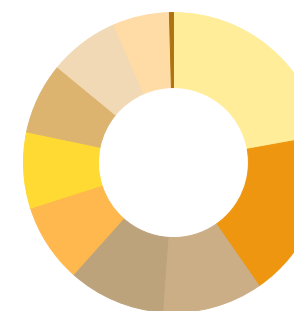
	%
● Renta Variable	84,1
● Renta Fija	0,0
● Efectivo	15,9
● Otros	0,0

Distribución País



	%
● Francia	28,6
● Alemania	12,9
● España	10,1
● Países Bajos	9,0
● Noruega	6,6
● Suiza	6,0
● Estados Unidos	5,6
● Italia	5,6
● Reino unido	5,2
● Canada	4,4
● Otros	6,0

Distribución Sectores



	%
● Salud	22,1
● Consumo Defensivo	18,2
● Servicios de Comunicación	10,8
● Materiales Básicos	10,5
● Servicios Financieros	8,5
● Tecnología	8,2
● Industria	7,7
● Servicios Públicos	7,5
● Consumo Cíclico	6,1
● Energía	0,4

10 Principales Posiciones

	Peso %
Euro Stoxx 50 Future Sept 20	7,61
Brookfield Asset Management Inc Class A	3,69
SAP SE	3,32
Fresenius SE & Co KGaA	2,98
L'Oreal SA	2,64
Novo Nordisk A/S B	2,62
Prosus NV Ordinary Shares - Class N	2,58
RELX PLC	2,57
Air Liquide SA	2,50
Enel SpA	2,49