

Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

A photograph of a man sitting in a dark wooden chair in a garden. He is wearing a plaid shirt and light-colored trousers, and is looking towards a red bicycle leaning against a stone wall. The scene is bathed in warm, golden light, suggesting late afternoon or early morning. The background features lush greenery and trees, with the sun creating a bright flare behind the man.

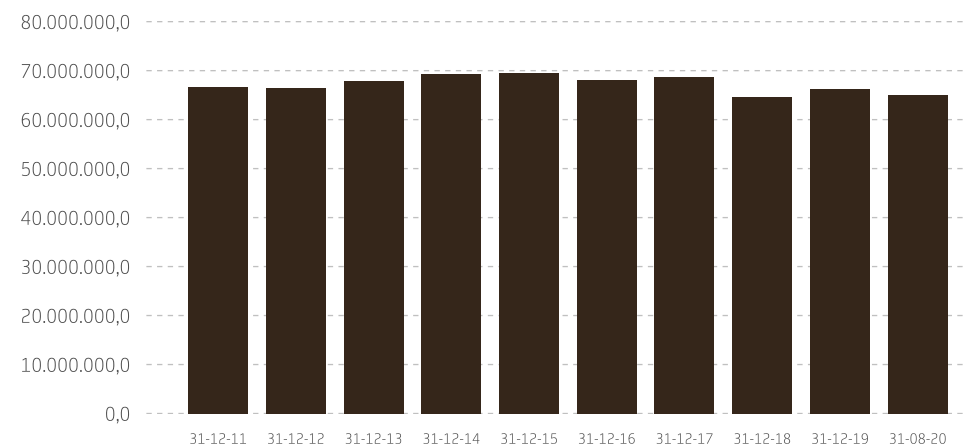
Bankia
pensiones >

1. Evolución de las principales magnitudes del Fondo

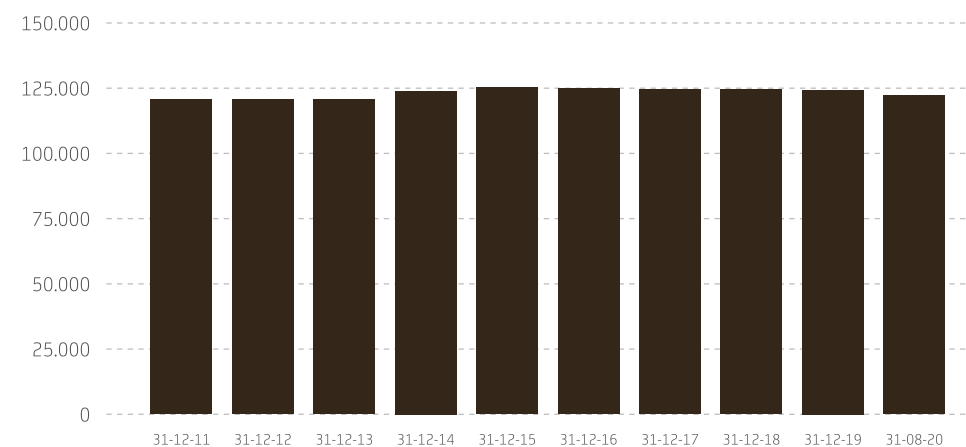
1.1 Patrimonio y partícipes

FECHA	PATRIMONIO	PARTICIPES
31-dic-2011	66.599.159,1	120.608
31-dic-2012	66.536.926,2	120.608
31-dic-2013	67.837.274,8	120.608
31-dic-2014	69.300.223,0	123.934
31-dic-2015	69.608.705,5	125.245
31-dic-2016	68.112.033,1	124.931
31-dic-2017	68.783.089,9	124.523
31-dic-2018	64.678.011,3	124.448
31-dic-2019	66.257.268,8	124.206
31-ago-2020	65.024.662,6	122.267

Evolución del patrimonio



Evolución de partícipes



2. Evolución de las principales magnitudes del Plan

2.1 Patrimonio Participes y Beneficiarios

FECHA	PATRIMONIO	ACTIVOS	PARTICIPES		BENEFICIARIOS
			SUSPENSO	TOTALES	
31-dic-2011	66.599.159,1	2.284	117.534	119.818	790
31-dic-2012	66.536.926,2	2.284	117.534	119.818	790
31-dic-2013	67.837.274,8	2.284	117.534	119.818	790
31-dic-2014	69.300.223,0	4.885	117.681	122.566	1.368
31-dic-2015	69.608.705,5	230	122.238	122.468	2.777
31-dic-2016	68.112.033,1	177	121.985	122.162	2.769
31-dic-2017	68.783.089,9	168	121.566	121.734	2.789
31-dic-2018	64.678.011,3	237	121.105	121.342	3.106
31-dic-2019	66.257.268,8	143	120.790	120.933	3.273
31-ago-2020	65.024.662,6	141	120.337	120.478	1.789

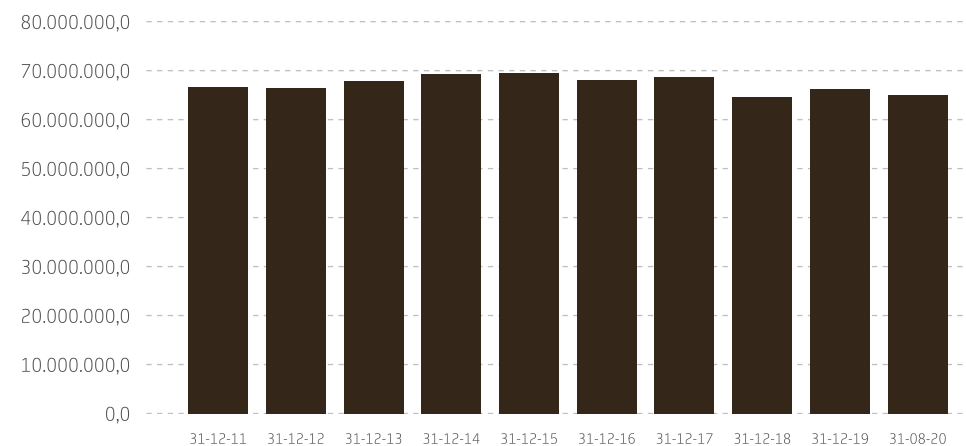
Movimientos del plan

	MES ACTUAL
Aportaciones Partícipes	86,5
Contribuciones Promotor	0,6
Movilizaciones Netas	-13,0
Prestaciones	1.325,1

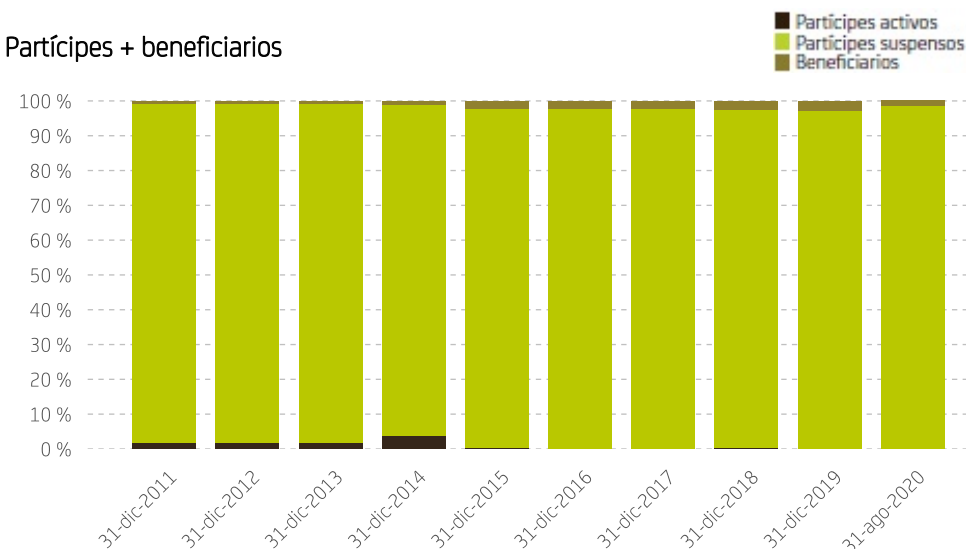
Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

Evolución del patrimonio



Partícipes + beneficiarios



NOTA: Se consideran 'Partícipes en Suspenseo' a aquellos que no han realizado aportaciones ni contribuciones durante los últimos 12 meses al plan.

3. Rentabilidades del Plan

3.1 Rentabilidades históricas

Fecha	VLP	Rentabilidad Mensual	Rentabilidad Interanual	Rent. Histór. Acumulada	Rent. Histór. Anualizada
31-dic-15	11,162896	-1,44 %	2,68 %	11,63 %	1,91 %
31-dic-16	11,191119	1,50 %	0,25 %	11,91 %	1,68 %
31-dic-17	11,583033	-0,17 %	3,50 %	15,83 %	1,95 %
31-dic-18	11,216637	-1,32 %	-3,16 %	12,17 %	1,34 %
31-dic-19	11,845626	0,33 %	5,61 %	18,46 %	1,83 %
31-ene-20	11,837298	-0,07 %	4,23 %	18,37 %	1,80 %
29-feb-20	11,624410	-1,80 %	1,70 %	16,24 %	1,58 %
31-mar-20	11,032870	-5,09 %	-3,90 %	10,33 %	1,00 %
30-abr-20	11,334285	2,73 %	-2,33 %	13,34 %	1,28 %
31-may-20	11,501623	1,48 %	0,36 %	15,02 %	1,43 %
30-jun-20	11,663195	1,40 %	0,42 %	16,63 %	1,57 %
31-jul-20	11,693102	0,26 %	0,27 %	16,93 %	1,58 %
31-ago-20	11,853522	1,37 %	2,06 %	18,54 %	1,72 %

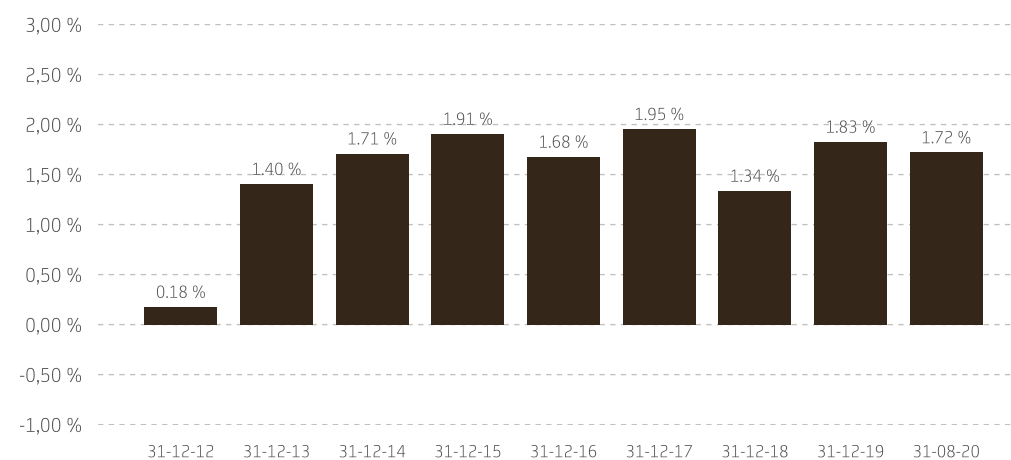
Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

Evolución rentabilidad acumulada



Evolución de rentabilidad histórica anualizada



3. Rentabilidades del Plan

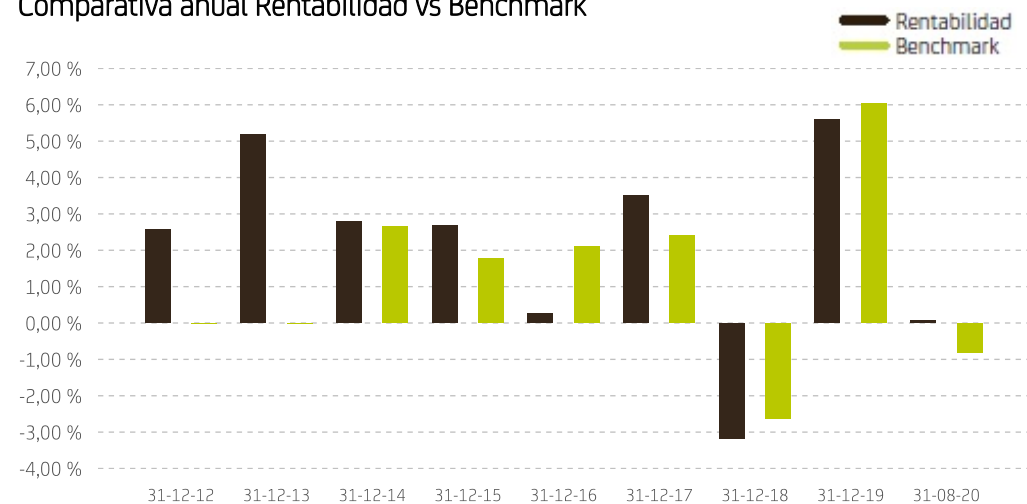
3.2 Rentabilidad vs Benchmark

FECHA	RENTABILIDAD	BENCHMARK
31-dic-12	2,57 %	
31-dic-13	5,19 %	
31-dic-14	2,80 %	2,66 %
31-dic-15	2,68 %	1,78 %
31-dic-16	0,25 %	2,10 %
31-dic-17	3,50 %	2,42 %
31-dic-18	-3,16 %	-2,62 %
31-dic-19	5,61 %	6,05 %
31-ago-20	0,07 %	-0,81 %

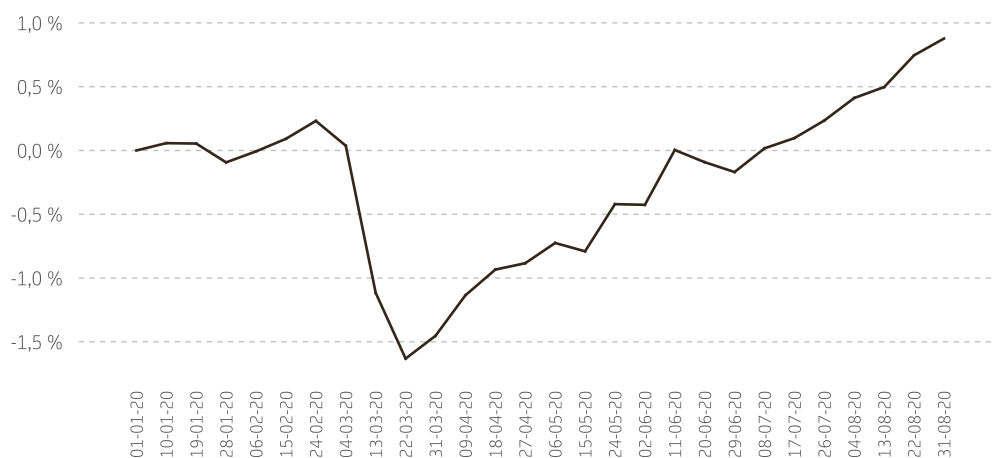
Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

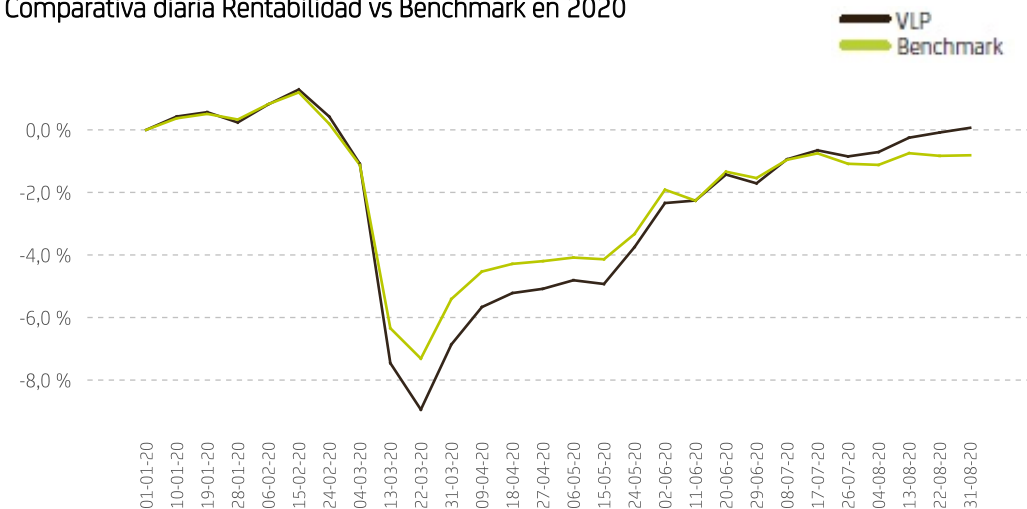
Comparativa anual Rentabilidad vs Benchmark



Diferencial diario Rentabilidad vs Benchmark en 2020



Comparativa diaria Rentabilidad vs Benchmark en 2020



Buen comportamiento de las bolsas en el mes de agosto, con una revalorización del S&P 500 de un 7 % (El mejor mes de agosto desde 1986). El repunte desde la caída de mitad de marzo continua, de tal forma que sube más de un 50% desde mínimos. Detrás de este buen comportamiento, encontramos uno de los asset allocation más selectivos en muchos años. A modo de ejemplo, la ganancia de capitalización la semana pasada de Apple es superior a la capitalización de 494 de las 500 empresas que integran el S&P 500. La propia Apple vale más que todo el FTSE 100 británico, y Tesla ya vale más que todo el IBEX -35. Las bolsas europeas han seguido la estela positiva, aunque no en la misma proporción, el Dax alemán ha cerrado con un 5,13%, mientras el Ibex ha seguido rezagado con una subida del 1,34%. Para entender esta discriminación entre sectores e índices, cabe destacar que el daño en el comercio mundial en cifras ha sido menos severo de lo esperado, debido curiosamente a los efectos de la propia pandemia. Por un lado, se ha multiplicado la compra de productos sanitarios y medicamentos, y por otro lado se ha incrementado también la compra de productos electrónicos, junto a toda la economía satélite que conlleva. En la otra cara de la moneda, encontramos el peor comportamiento de sectores como viajes, restauración o ventas en comercios, todos ellos muy ligados a la movilidad y con mayor peso en las economías de los países del sur de Europa.

Aunque en cuanto a lo que el ritmo de contagios se refiere, la pandemia está evolucionando peor de lo esperado, los niveles alcanzados por los índices van poco a poco consolidándose. Esto es debido a las perspectivas de contar con una vacuna a corto plazo, unido a mejores técnicas de rastreo y mayor volumen de pruebas realizadas, lo que se traduce en un menor índice de mortalidad y de presión sanitaria. Gracias a estas medidas, se está evitando una vuelta a medidas estrictas de aislamiento que pudieran poner en riesgo la recuperación económica.

Echando un vistazo a los datos macro, en Europa, las encuestas de confianza de agosto reflejan las cautelas de los empresarios acerca de la duración e intensidad de la recuperación. En Alemania, el dato Ifo registra la menor subida de los últimos meses (92,6 vs 90,4); mientras que la confianza del consumidor cae (53,7 vs 55,7), aunque bastante menos que los países del sur de Europa y que en la UEM (51,6 vs 54,9). En EEUU, los datos han tenido un comportamiento mixto, por un lado pierden algo de fuerza las ventas minoristas (1,2% vs 8,4% en junio), la producción industrial (3,0% vs 5,7%) y la creación de empleo (1,8 vs 4,8 millones) y por el lado positivo, destaca el sector residencial, que se encuentra en uno de sus mejores momentos desde 2006, impulsado por los bajos tipos de interés y los cambios de hábito por la pandemia.

En la reunión de banqueros centrales en Jackson Hole, se ha confirmado que el objetivo de inflación de la Fed, que actualmente es del 2%, pasará a ser flexible, de tal forma que se permitirá que, puntualmente, pueda superar dicho nivel, persiguiendo así una inflación media. Esta decisión, dará más margen a la Fed de no tener que responder con un endurecimiento monetario si se diera el caso de que convivieran por un lado una inflación que alcance o supere el 2% y por otro una tasa de paro en niveles elevados y alejados de su objetivo.

En principio, la mayor tolerancia de la Fed a una inflación superior al 2% no es una buena noticia para los bonos, de hecho, han sido las tirsas a más largo plazo las que han repuntado con más intensidad (el 30 años de EEUU +10 pb vs +6 pb el 10 años). Las rentabilidades a 10 años de EEUU y Alemania, así como las de los bonos periféricos, se han movido lateralmente en agosto, cerrando el mes en la parte alta del rango.

El cruce del euro con el dólar llegó a rozar el nivel de 1,20 eur/usd, dando paso, seguidamente, a un proceso de consolidación en el que aún sigue inmerso con un nivel de 1,17 en la banda baja, no obstante, la estrategia monetaria de la Fed, más tolerante con la inflación, ha llevado al dólar a debilitarse frente al euro, cerrando el mes en la parte alta del rango 1,19.

5. Composición de la cartera de inversiones

5.1 Por clases de activos

Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

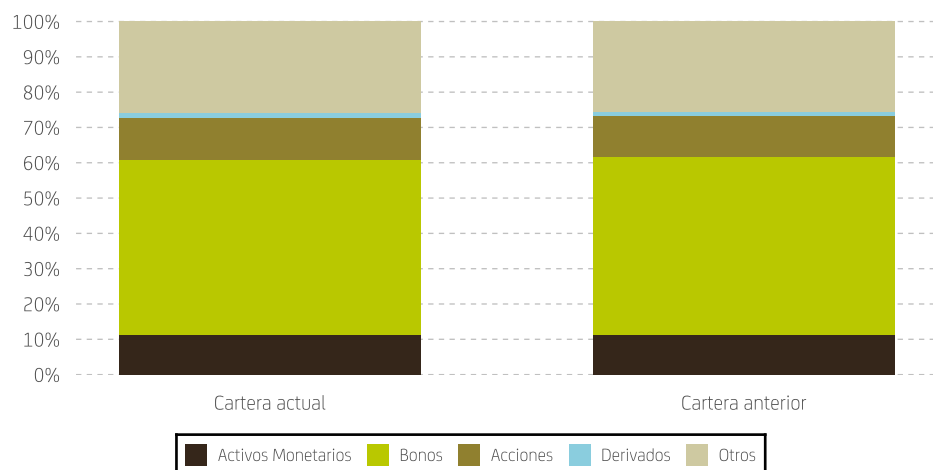
CLASE DE ACTIVO	CARTERA ACTUAL		CARTERA ANTERIOR	
	CUANTÍA	%	CUANTÍA	%
Activos Monetarios	7.435.437	11,32 %	7.321.049	11,29 %
Bonos	32.602.049	49,64 %	32.731.341	50,48 %
IIC's Renta Fija	7.564.888	11,52 %	7.557.830	11,66 %
Total Renta Fija	47.602.373	72,47 %	47.610.220	73,43 %
Acciones	7.842.566	11,94 %	7.484.306	11,54 %
IIC's Renta Variable	6.807.487	10,36 %	6.504.652	10,03 %
Efecto Derivados RV	815.586	1,24 %	627.400	0,97 %
Total Renta Variable	15.465.639	23,55 %	14.616.357	22,54 %
Otros	2.613.431	3,98 %	2.608.216	4,02 %
TOTAL CARTERA	65.681.442	100,00 %	64.834.794	100,00 %

NOTA: La cuantía "Total Cartera" podrá diferir de "Patrimonio", por el efecto de los derivados.

ACTIVOS MONETARIOS: Incluye posiciones en Depósitos, Eurodepósitos, Repos y Activos Financieros con vencimiento inferior a 3 meses.

OTROS: Incluye los fondos no catalogados como renta fija o variable, inmuebles y el resto de activos no catalogados en los grupos anteriores.

Evolución de la cartera



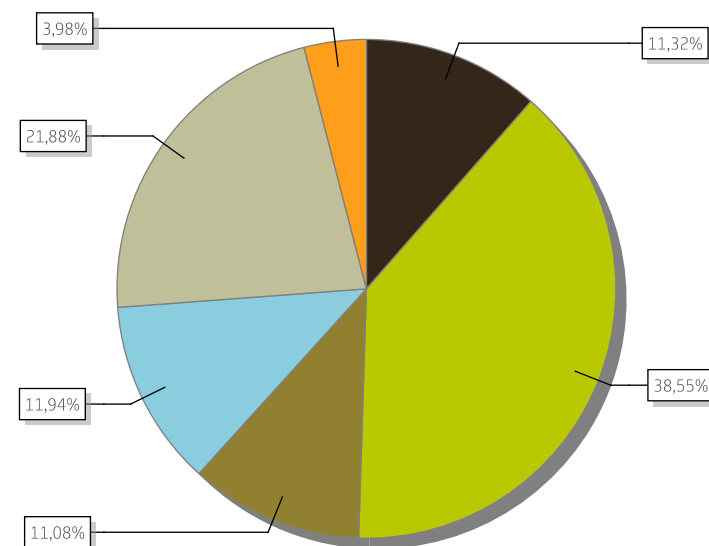
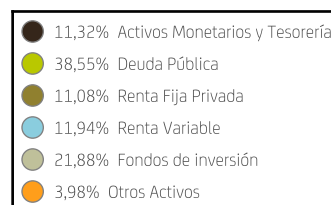
5. Composición de la cartera de inversiones

5.2 Por datos geográficos

CLASE DE ACTIVO GEOGRÁFICO	CARTERA ACTUAL	
	CUANTÍA	%
Activos Monetarios y Tesorería	7.435.437	11,32 %
Deuda Pública	25.321.565	38,55 %
- Nacional	17.798.667	27,10 %
- Zona Euro	2.781.717	4,24 %
- Resto de Países	4.741.181	7,22 %
Renta Fija Privada	7.280.483	11,08 %
- Nacional	5.251.379	8,00 %
- Zona Euro	2.029.105	3,09 %
Renta Variable	7.842.566	11,94 %
- Nacional	458.467	0,70 %
- Zona Euro	6.741.607	10,26 %
- Resto de Países	642.492	0,98 %
Fondos de inversión	14.372.374	21,88 %
Otros Activos	2.613.431	3,98 %
Derivados	815.586	1,24 %
- Renta Variable	815.586	1,24 %
Total Cartera	65.681.442	100,00 %

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre el patrimonio.

Desglose por activos



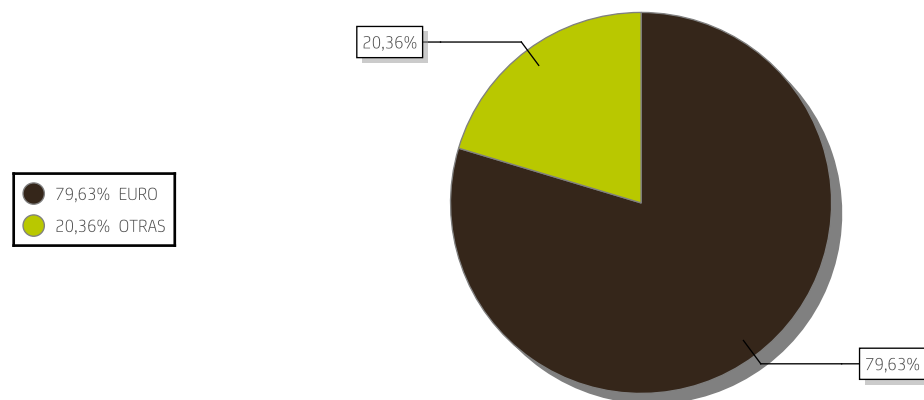
5. Composición de la cartera de inversiones

5.3 Por riesgo divisa

DIVISA	CARTERA ACTUAL		CARTERA ANTERIOR	
	CUANTÍA	%	CUANTÍA	%
EURO	48.050.063	79,63 %	47.887.046	74,58 %
USD Dólar USA	9.788.700	16,22 %	15.391.763	23,97 %
JPY Yen Japonés.	1.751.921	2,90 %	236.955	0,37 %
DKK Corona Danesa	710.707	1,18 %	654.365	1,02 %
GBP Libra Esterlina	37.109	0,06 %	36.808	0,06 %
CHF Franco Suizo	455	0,00 %	456	0,00 %
TOTAL	60.338.955	100,00 %	64.207.393	100,00 %

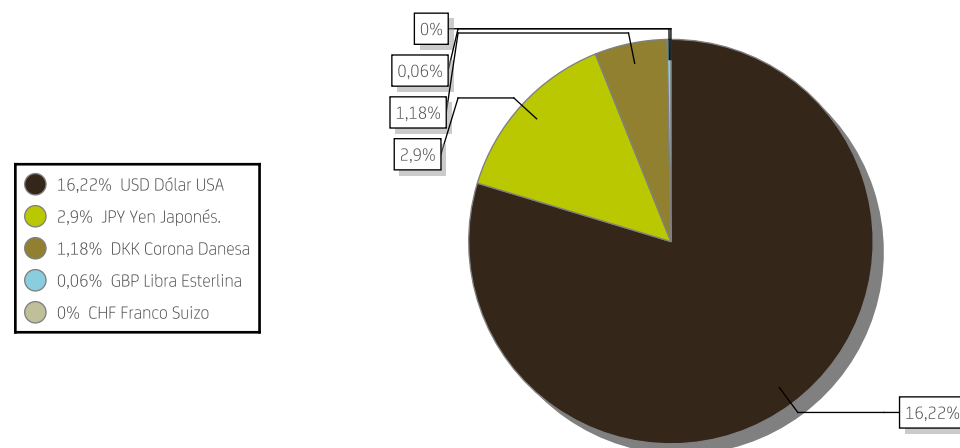
NOTA: Los porcentajes están calculados sobre la cifra total de inversión. La cuantía hace referencia a la posición del fondo en cada divisa neta de derivados, si los hubiera), expresada por su contravalor en euros. Los posibles importes negativos se deben al exceso de cobertura de la divisa como consecuencia de la fluctuación del mercado y no debe ser interpretado como descubiertos en cuenta corriente. Los ICC se incluyen en la divisa del activo (inversión directa). La cuantía "Total Cartera" podrá diferir de "Patrimonio por el efecto de los derivados".

Distribución por riesgo divisa



DESGLOSE DE DERIVADOS	CARTERA ACTUAL				
	POS	CONTR	CUANTÍA	DIV	%
FUT. EURO E-MINI VTO. SEP 20 (EEU0)	P.C.	129	-8.064.864,18	USD	-13,37
FUT. EURO/JAPANESE YEN VTO. SEP 20	P.V.	5	627.582,23	JPY	1,04 %
TOTAL			-7.437.281,95		-12,33

Desglose otras divisas



6. Composición de la cartera de renta fija contado

6.1 Por plazos y rating

Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

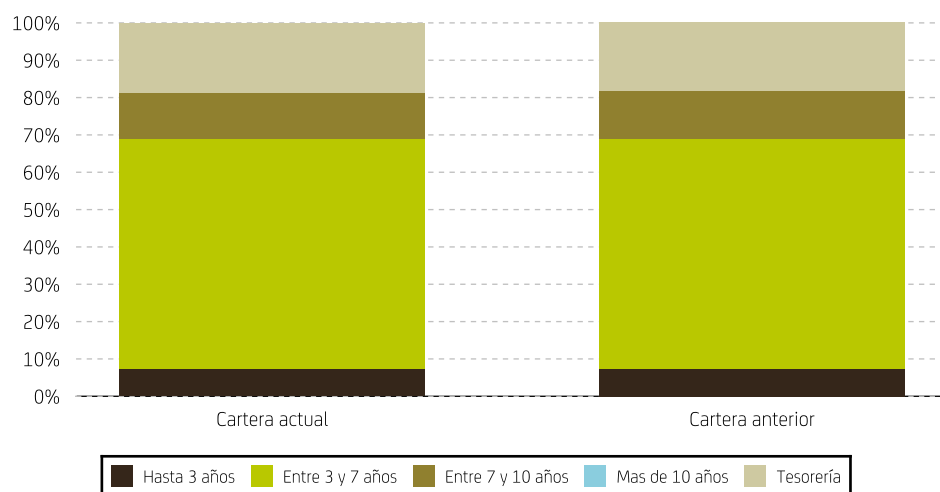
PLAZOS	CARTERA ACTUAL				CARTERA ANTERIOR			
	CUANTÍA	%	DURACIÓN	SENSIB.	CUANTÍA	%	DURACIÓN	SENSIB.
Hasta 3 años	2.885.764	7,21 %	1,27	35.971	2.910.414	7,27 %	1,35	38.550
Entre 3 y 7 años	24.760.546	61,84 %	4,23	1.039.950	24.755.676	61,81 %	4,31	1.061.051
Entre 7 y 10 años	4.955.739	12,38 %	7,77	378.724	5.065.251	12,65 %	7,81	387.797
Tesorería	7.435.437	18,57 %	0,00	204	7.321.049	18,28 %	0,00	201
TOTAL	40.037.485	100,00 %	3,67	1.454.849	40.052.390	100,00 %	3,75	1.487.599

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre el conjunto de la inversión directa en bonos.

La sensibilidad hace referencia al cambio en valor ante una variación de rentabilidades de 100 pb.

La duración y la sensibilidad no incluyen posiciones en derivados ni en IIC's.

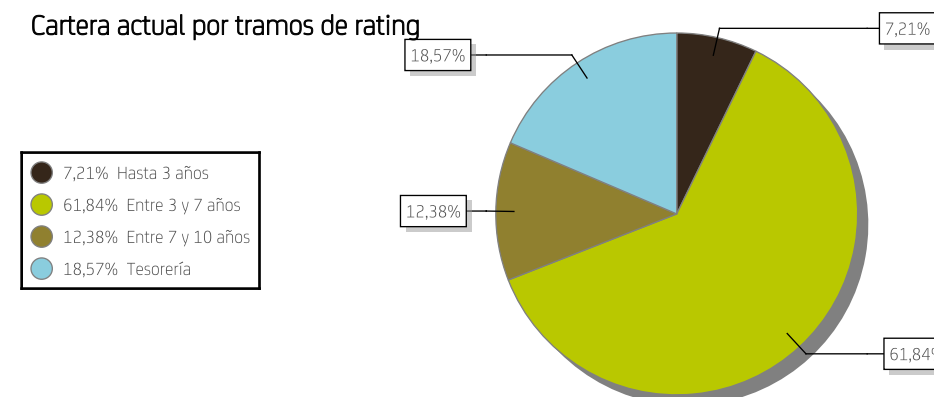
Evolución de la cartera



RATING	CARTERA ACTUAL		
	CUANTÍA	%	% ACUMULADO
AAA	4.741.181	14,54 %	14,54 %
AA	523.433	1,61 %	16,15 %
A	11.703.851	35,90 %	52,05 %
BBB	15.633.583	47,95 %	100,00 %
TOTAL	32.602.049	100,00 %	

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre el conjunto de la inversión directa en bonos. El tramo AAA incluye la calificación AAA, el tramo AA incluye las calificaciones AA, AA+ y AA-, el tramo A incluye las calificaciones A, A+ y A-, el tramo BBB incluye las calificaciones BBB, BBB+ y BBB-. Calificaciones según S&P y, en su defecto, la equivalente de Moody's. No se incluyen para este cálculo ni derivados, ni IIC's.

Cartera actual por tramos de rating



6. Composición de la cartera de renta fija contado

6.2 Principales activos de la cartera y derivados

PRINCIPALES ACTIVOS DE LA CARTERA	CARTERA ACTUAL		
	CUANTÍA	%	RATING
BN. ESTADO 0.25% VTO. 07/24	4.909.674	10,31 %	A
OB. COMUNIDAD MADRID 4.125% VTO.	2.313.070	4,86 %	A-
OB. ESTADO 3.80% VTO. 04/24	2.007.840	4,22 %	BBB+
OB. ESTADO 2.15% VTO. 10/25	1.858.212	3,90 %	BBB+
OB. ESTADO 2.75% VTO. 10/24	1.857.928	3,90 %	BBB+
OB. ESTADO 1.60% VTO. 04/25	1.841.359	3,87 %	BBB+
OB. TESORO AMERICANO 2.75% VTO.	1.804.134	3,79 %	AAA
OB. ESTADO 4.65% VTO. 07/25	1.724.169	3,62 %	BBB+
OB. US TREASURY N/B 1.625% 08/29	1.491.865	3,13 %	AAA
BN. TESORO AMERICANO 1.125% VTO.	1.445.182	3,04 %	AAA
OB. ESTADO ITALIANO 2.50% VTO 12/24	996.091	2,09 %	BBB-
BN. ESTADO ITALIANO 1.45% VTO. 11/24	955.350	2,01 %	BBB-
OB. RED ELECTRICA FINANCIACIONES	707.910	1,49 %	A-
OB. COMUNIDAD MADRID 0.419% VTO.	662.052	1,39 %	A-
OB. ESTADO ITALIANO 0.35% VTO. 02/25	624.413	1,31 %	BBB

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre la cifra total de exposición a renta fija.

DESGLOSE DE DERIVADOS	CARTERA ACTUAL				
	POS	CONTR	CUANTÍA	DIV	%
TOTAL			0,00		0,00 %
TOTAL EXPOSICIÓN A RENTA FIJA			47.602.372,82		72,47 %

NOTA: El desglose de derivados está calculado sobre el total de renta fija.
El total de exposición a renta fija está calculado sobre el total de cartera.

7. Composición de la cartera de renta variable y otros

7.1 Desglose sectorial y desglose geográfico

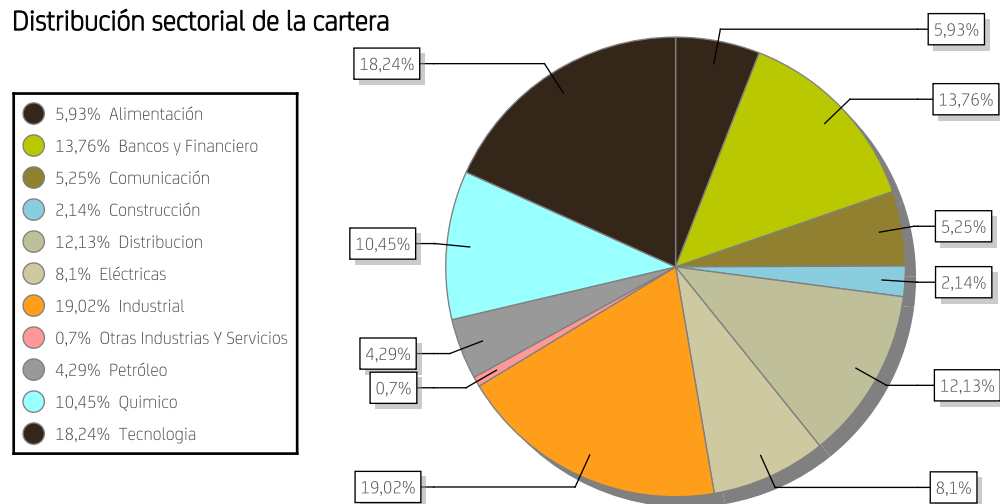
Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

SECTOR	CARTERA ACTUAL	
	CUANTÍA	%
Alimentación	465.246,80	5,93 %
Bancos y Financiero	1.079.446,56	13,76 %
Comunicación	411.653,07	5,25 %
Construcción	167.453,98	2,14 %
Distribución	950.974,77	12,13 %
Eléctricas	635.636,42	8,10 %
Industrial	1.491.392,16	19,02 %
Otras Industrias Y Servicios	54.686,86	0,70 %
Petróleo	336.163,40	4,29 %
Químico	819.402,32	10,45 %
Tecnología	1.430.509,77	18,24 %
TOTAL	7.842.566,11	100,00 %

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre el conjunto de la inversión directa en acciones.

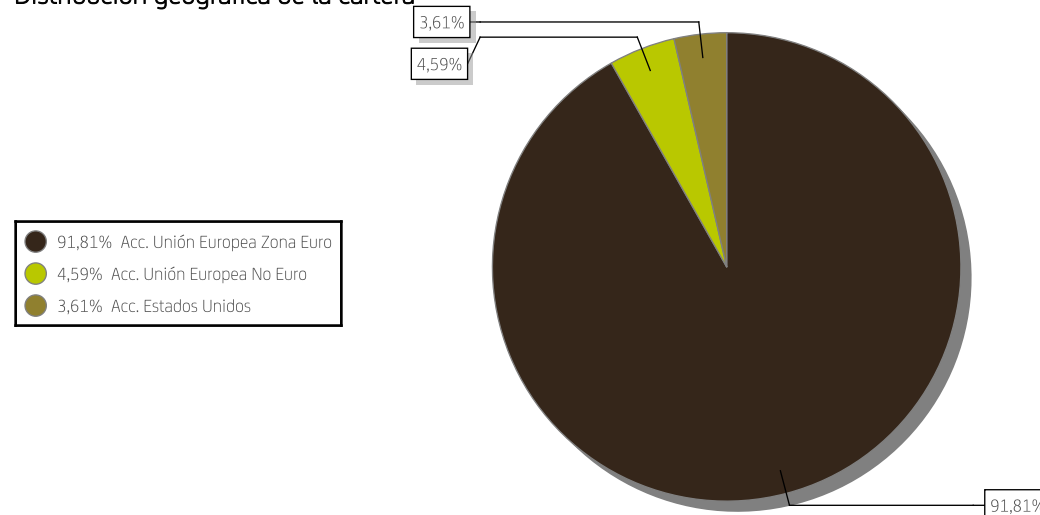
Distribución sectorial de la cartera



ÁREA GEOGRÁFICA	CARTERA ACTUAL	
	CUANTÍA	%
Acc. Unión Europea Zona Euro	7.200.073,95	91,81 %
Acc. Unión Europea No Euro	359.756,57	4,59 %
Acc. Estados Unidos	282.735,59	3,61 %
TOTAL	7.842.566,11	100,00 %

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre el conjunto de la inversión directa en acciones. Las áreas son países, salvo en el caso particular de la Unión Europea.

Distribución geográfica de la cartera



7. Composición de la cartera de renta variable y otros

7.2 Principales activos de la cartera, derivados y otros activos

Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

ACTIVOS DE RENTA VARIABLE	CARTERA ACTUAL	
	CUANTÍA	%
AC. SAP (SAP GR)	571.761,68	3,70 %
AC. LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	555.419,20	3,59 %
AC. ASML HOLDING (ASML NA)	507.594,50	3,28 %
AC. SANOFI (SAN FP)	457.279,56	2,96 %
AC. SIEMENS (SIE GR)	446.678,92	2,89 %
AC. AP MOELLER- MAERSK- B (MAERSKB DC)	359.756,57	2,33 %
AC. SCHNEIDER ELECTRIC (SU FP)	327.538,75	2,12 %
AC. ALLIANZ (ALV GR)	317.478,48	2,05 %
AC. TOTAL (FP FP)	289.823,60	1,87 %
AC. BNP-PARIBAS (BNP FP)	286.450,21	1,85 %
AC. FACEBOOK - A (FB US)	282.735,59	1,83 %
AC. ENEL (ENEL IM)	281.658,15	1,82 %
AC. DEUTSCHE TELEKOM (DTE GR)	235.454,25	1,52 %
AC. KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE (AD NA)	213.008,12	1,38 %
AC. E.ON (EOAN GR)	200.697,32	1,30 %

OTROS ACTIVOS	CARTERA ACTUAL	
	CUANTÍA	%
Inversión Indirecta	436.181,88	5,56 %
TOTAL	436.181,88	5,56 %

DESGLOSE DE DERIVADOS	CARTERA ACTUAL				
	POS	CONTR	CUANTÍA	DIV	%
FUT. DJ EURO STOXX 50 VTO. SEP 20	P.V.	66	-2.154.900,00	EUR	-13,93 %
FUT. NASDAQ 100 E-MINI VTO. SEP 20	P.C.	8	1.623.860,59	USD	10,50 %
FUT. MINI TOPIX VTO. SEP 20 (TMIU0)	P.C.	67	860.257,43	JPY	5,56 %
FUT. MICRO NASDAQ 100 E-MINI VTO.	P.C.	21	426.263,40	USD	2,76 %
FUT. EUROSTOXX AUTOS VTO. SEP 20	P.C.	3	60.105,00	EUR	0,39 %
TOTAL			815.586,42		5,27 %

TOTAL EXPOSICIÓN A RENTA VARIABLE			15.465.639,07		23,55 %
--	--	--	----------------------	--	----------------

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre la cifra total de exposición a renta variable.

NOTA: El desglose de derivados está calculado sobre el total de renta variable.
El total de exposición a renta variable está calculado sobre el total de cartera.

8. Composición de la inversión en IIC'S

8.1 Principales activos de la cartera

Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020

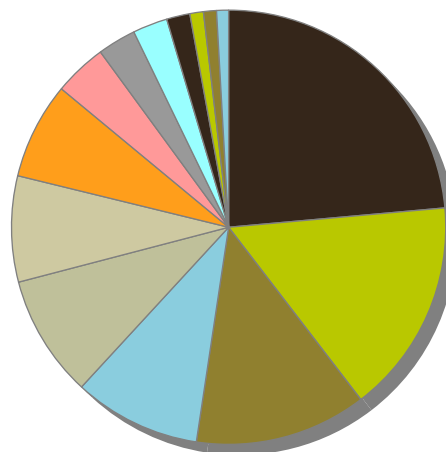
PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

FONDO	CARTERA ACTUAL	
	CUANTÍA	%
PT. LYXOR ETF S&P 500 (LSPU LN)	4.003.538	6,10 %
PT. LYXOR ETF EUR GOVERNMENT BOND 3-5Y DR ETF -FR- (MTB FP)	1.610.222	2,45 %
PT. BLACKROCK SF- FIXED INCOME STRAT-I2E (BRFXI2 LX)	1.355.600	2,06 %
PT. CANDRIAM BONDS - CREDIT OPPORTUNITIES S-C (DEXHISP LX)	1.340.603	2,04 %
PT. AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF (AUEM FP)	1.229.349	1,87 %
PT. VONTOBEL FUND - EMERGING MARKETS DEBT USD (VOEMDGU LX)	1.222.325	1,86 %
PT. BLACKSTONE DIVERSIFIED MULTI-STRAT-I EUR ACC(BXDMSIE ID)	1.157.114	1,76 %
PT. HENDERSON GARTMORE-UK ABSOLUTE RET-I EUR AH (GAUKARI LX)	1.020.135	1,55 %
PT. NORDEA 1- LOW DURATION EUROPEAN EUR (NOLDBIE LX)	694.936	1,06 %
PT. NN L - EURO GREEN BOND IC EUR (NNEGICE LX)	671.683	1,02 %
TOTAL	14.305.505	21,78 %

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre el patrimonio.

Desglose por activos

●	18,3% R.V.I. EE.UU.
●	12,42% R.F.I. Crédito
●	9,93% IIC DE RETORNO ABSOLUTO
●	7,35% R.F.I. Europa
●	7,05% R.V.I. Emergente Global
●	6,12% R.F.I. Retorno Absoluto
●	5,58% R.F.I. RF emergente deuda externa
●	3,06% R.F.I. Renta Fija
●	2,22% R.V.I. Globales
●	2,01%
●	1,35% R.V.I. Europa
●	0,78% R.V.I.
●	0,75% R.V.I. Servicios públicos
●	0,69% R.V.I. Salud



9. Operaciones realizadas durante el mes

Informe de Gestión a 31 de agosto de 2020
PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

FECHA	FONDO	OPERACIÓN	%TIR OPERACIÓN	COTIZACIÓN	VALOR COMPRA	VALOR VENTA	GASTOS OPERACIÓN	PLUSVALÍAS / MINUSVALÍAS
03-08-2020	AC. MERLIN PROPERTIES SOCIMI (MRL SM)	Compra		6,79	4.556,70		1,82	
07-08-2020	PT. ALTAMAR IX GLOBAL SECONDARIES CLASE D FCR	Venta		1,40		4.944,12	0,00	820,81
11-08-2020	AC. MERLIN PROPERTIES SOCIMI (MRL SM)	Venta		7,86		3.481,12	1,39	465,18
11-08-2020	PT. ALTAMAR X GLOBAL PRIVATE EQUITY PROGRAM CLASE E	Compra		0,95	15.000,00		0,00	
11-08-2020	PT. ALTAMAR X GLOBAL PRIVATE EQUITY PROGRAM CLASE E	Venta		1,00		15.000,00	0,00	198,80
12-08-2020	AC. MERLIN PROPERTIES SOCIMI (MRL SM)	Venta		7,74		2.969,36	1,19	355,09
13-08-2020	AC. MERLIN PROPERTIES SOCIMI (MRL SM)	Venta		7,72		9.024,46	3,61	1.065,93
25-08-2020	AC. MERLIN PROPERTIES SOCIMI (MRL SM)	Venta		7,66		7.311,42	2,93	809,80
26-08-2020	AC. MERLIN PROPERTIES SOCIMI (MRL SM)	Venta		7,72		6.072,66	2,43	714,78
TOTAL					19.556,70	48.803,14	13,37	4.430,39

NOTA: En las plusvalías/minusvalías está contemplado el pago de cupones pero no el de dividendos.

Pensioval VII, F.P. (PP Personal Empleado Público)

de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

COMPOSICIÓN DE LA CARTERA		PATRIMONIO: 65.024.662,62				FECHA VALORACIÓN 31/08/2020					VARIACIÓN		Vencimiento	
Nombre del Valor	Nº. títulos	COSTE MEDIO DE ADQUISICIÓN				VALOR DE MERCADO					VARIACIÓN		Vencimiento	
		Cambio (*)	Ex-Cupón	Cup.	Coste Medio	Precio	Ex-Cupón	Cup.	Valor	% s/pal.	%			
ES0000012E85 - BN. ESTADO 0.25% VTO.	4.807	101,69	T	4.883.765,0	0,00	4.883.765,02	102,14	4.908.619,98	1.053,59	4.909.673,57	7,55 %	25.908,55	0,53 %	30/07/2024
US912828ZA13 - BN. TESORO AMERICANO	17.000	101,13	T	1.521.868,6	0,00	1.521.868,65	101,47	1.445.182,31	0,00	1.445.182,31	2,22 %	-76.686,34	-5,04 %	28/02/2022
IT0005282527 - BN. ESTADO ITALIANO 1.45%	910	106,10	T	961.970,10	0,00	961.970,10	104,98	951.477,80	3.872,45	955.350,25	1,47 %	-6.619,85	-0,69 %	15/11/2024
ES00000122E5 - OB. ESTADO 4.65% VTO.	1.388	128,67	T	1.749.707,8	0,00	1.749.707,84	124,22	1.718.510,56	5.658,48	1.724.169,04	2,65 %	-25.538,80	-1,46 %	30/07/2025
ES00000124W3 - OB. ESTADO 3.80% VTO.	1.725	120,11	T	2.023.992,6	0,00	2.023.992,68	116,40	2.007.840,45	0,00	2.007.840,45	3,09 %	-16.152,23	-0,80 %	30/04/2024
ES00000126B2 - OB. ESTADO 2.75% VTO.	1.617	114,07	T	1.842.013,5	11.845,89	1.853.859,40	112,61	1.820.871,36	37.056,25	1.857.927,61	2,86 %	4.068,21	0,22 %	31/10/2024
ES00000126Z1 - OB. ESTADO 1.60% VTO.	1.690	110,45	T	1.843.057,1	0,00	1.843.057,10	108,96	1.832.247,30	9.112,11	1.841.359,41	2,83 %	-1.697,69	-0,09 %	30/04/2025
ES00000127G9 - OB. ESTADO 2.15% VTO.	1.634	112,93	T	1.841.893,6	9.382,70	1.851.276,38	111,93	1.828.936,20	29.275,83	1.858.212,03	2,86 %	6.935,65	0,37 %	31/10/2025
ES0000101602 - OB. COMUNIDAD MADRID	1.980	122,58	T	2.352.279,6	0,00	2.352.279,60	116,82	2.290.246,20	22.824,25	2.313.070,45	3,56 %	-39.209,15	-1,67 %	21/05/2024
ES0000101768 - OB. COMUNIDAD MADRID	400	104,55	T	418.076,00	697,36	418.773,36	104,31	417.248,00	3.661,11	420.909,11	0,65 %	2.135,75	0,51 %	30/09/2024
ES0000101933 - OB. COMUNIDAD MADRID	667	100,62	T	665.852,76	0,00	665.852,76	99,26	661.110,39	941,79	662.052,18	1,02 %	-3.800,58	-0,57 %	30/04/2030
US9128283W81 - OB. TESORO AMERICANO	18.500	99,95	T	1.571.463,4	0,00	1.571.463,44	116,40	1.802.280,67	1.853,18	1.804.133,85	2,77 %	232.670,41	14,81 %	15/02/2028
US912828YB05 - OB. US TREASURY N/B	16.380	99,26	T	1.468.580,5	0,00	1.468.580,50	108,71	1.490.895,64	969,57	1.491.865,21	2,29 %	23.284,71	1,59 %	15/08/2029
IT0005045270 - OB. ESTADO ITALIANO 2.50%	910	111,17	T	1.006.814,9	0,00	1.006.814,90	109,46	990.434,90	5.656,42	996.091,32	1,53 %	-10.723,58	-1,07 %	01/12/2024
IT0005386245 - OB. ESTADO ITALIANO 0.35%	626	97,73	T	587.939,20	0,00	587.939,20	99,75	624.234,68	178,61	624.413,29	0,96 %	36.474,09	6,20 %	01/02/2025
TOTAL EFECTOS PÚBLICOS						24.761.200,93				24.912.250,08	38,31 %	151.049,15	0,61 %	
XS2115156270 - BN. BANCO SANTANDER	3	100,00	T	300.000,00	0,00	300.000,00	98,15	294.441,00	7,00	294.448,00	0,45 %	-5.552,00	-1,85 %	11/02/2025
XS2023633931 - BN. BANK OF IRELAND	200	99,66	T	199.504,00	0,00	199.504,00	100,28	200.344,00	221,92	200.565,92	0,31 %	1.061,92	0,53 %	08/07/2023
ES0313307219 - BN. BANKIA SA 1% VTO. 06/24	1	99,96	T	100.435,00	0,00	100.435,00	98,74	98.557,00	183,56	98.740,56	0,15 %	-1.694,44	-1,69 %	25/06/2024
XS2173111282 - BN. ICO 0.25% VTO. 04/24	200	99,97	T	201.088,00	0,00	201.088,00	101,73	203.302,00	150,68	203.452,68	0,31 %	2.364,68	1,18 %	30/04/2024
XS2170609403 - BN. GLAXOSMITHKLINE CPTL	200	99,90	T	199.348,00	0,00	199.348,00	100,64	201.206,00	76,03	201.282,03	0,31 %	1.934,03	0,97 %	12/04/2023
XS2100690036 - BN. SANTANDER CONSUMER	6	99,80	T	598.302,00	0,00	598.302,00	100,09	599.172,00	1.395,49	600.567,49	0,92 %	2.265,49	0,38 %	17/01/2025

(*) Indicativo de cambio/precio: P-Importe por título. T-Porcentaje del nominal. En Renta Fija siempre es ex-cupón.

Importe en Euros

Pensioval VII, F.P. (PP Personal Empleado Público

de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

COMPOSICIÓN DE LA CARTERA		PATRIMONIO: 65.024.662,62					FECHA VALORACIÓN 31/08/2020							
Nombre del Valor	Nº. títulos	COSTE MEDIO DE ADQUISICIÓN					VALOR DE MERCADO					VARIACIÓN		Vencimiento
		Cambio (*)	Ex-Cupón	Cup.	Coste Medio	Precio	Ex-Cupón	Cup.	Valor	% s/pal.	%			
XS2008921947 - BN. AEGON BANK 0.625%	100	99,49	T	100.540,00	0,00	100.540,00	102,07	101.953,00	121,58	102.074,58	0,16 %	1.534,58	1,53 %	21/06/2024
ES0312298054 - CED. AYT CAJA GLOBAL 4%	5	0,83	T	416.805,00	0,00	416.805,00	104,15	511.975,00	8.767,12	520.742,12	0,80 %	103.937,12	24,94 %	24/03/2021
ES0213307053 - OB. BANKIA S.A. 0.75% VTO.	5	99,80	T	497.185,00	0,00	497.185,00	99,10	494.955,00	544,52	495.499,52	0,76 %	-1.685,48	-0,34 %	09/07/2026
XS2079713322 - OB. BBVA 0.375% VTO. 11/26	4	99,44	T	398.328,00	0,00	398.328,00	99,92	398.476,00	1.188,52	399.664,52	0,61 %	1.336,52	0,34 %	15/11/2026
ES0213679JR9 - OB.BANKINTER 0.625% VTO.	3	99,63	T	299.703,00	0,00	299.703,00	96,59	288.717,00	1.060,45	289.777,45	0,45 %	-9.925,55	-3,31 %	06/10/2027
XS2113889351 - OB. BSCH 0.5% VTO. 02/27	5	99,49	T	496.950,00	0,00	496.950,00	98,12	489.185,00	1.427,60	490.612,60	0,75 %	-6.337,40	-1,28 %	04/02/2027
FR0013444759 - OB.BNP PARIBAS 0.125%	2	99,26	T	197.324,00	0,00	197.324,00	97,66	195.064,00	247,27	195.311,27	0,30 %	-2.012,73	-1,02 %	04/09/2026
XS2013574038 - OB. CAIXABANK 1.375% VTO	6	99,41	T	604.746,00	0,00	604.746,00	101,70	608.526,00	1.650,00	610.176,00	0,94 %	5.430,00	0,90 %	19/06/2026
IT0005386922 - OB. BANCA MONTE DEI	200	99,62	T	202.064,00	0,00	202.064,00	102,93	204.294,00	1.568,31	205.862,31	0,32 %	3.798,31	1,88 %	08/10/2026
TOTAL FINANCIERO						4.812.322,00				4.908.777,05	7,55 %	96.455,05	2,00 %	
XS2133390521 - BN. VATTENFALL 0.05% VTO.	100	100,06	T	98.066,00	0,00	98.066,00	99,57	99.549,00	23,56	99.572,56	0,15 %	1.506,56	1,54 %	15/07/2025
XS2103014291 - OB. E.ON SE 0.375 % VTO.	300	98,92	T	297.447,00	0,00	297.447,00	101,35	303.357,00	700,82	304.057,82	0,47 %	6.610,82	2,22 %	29/06/2027
XS2103013210 - OB. RED ELECTRICA	7	99,29	T	705.803,00	0,00	705.803,00	101,13	707.637,00	273,29	707.910,29	1,09 %	2.107,29	0,30 %	24/04/2028
TOTAL ELÉCTRICAS						1.101.316,00				1.111.540,67	1,71 %	10.224,67	0,93 %	
XS2168625460 - BN. PEPSICO 0.25% VTO.	200	99,87	T	200.122,00	0,00	200.122,00	101,41	202.662,00	160,27	202.822,27	0,31 %	2.700,27	1,35 %	06/04/2024
XS2170362326 - BN. NESTLE FINANCE	316	100,04	T	314.925,60	0,00	314.925,60	100,50	317.570,52	0,00	317.570,52	0,49 %	2.644,92	0,84 %	11/08/2024
TOTAL ALIMENTACIÓN						515.047,60				520.392,79	0,80 %	5.345,19	1,04 %	
XS0907289978 - OB. TELEFONICA EMISIONES	4	1,00	T	401.024,00	0,00	401.024,00	103,98	409.080,00	6.858,50	415.938,50	0,64 %	14.914,50	3,72 %	26/03/2021
ES0200002006 - OB. ADIF ALTAVELOCIDAD	3	110,45	T	325.191,00	0,00	325.191,00	109,10	323.982,00	3.319,67	327.301,67	0,50 %	2.110,67	0,65 %	28/01/2025
TOTAL COMUNICACIÓN						726.215,00				743.240,17	1,14 %	17.025,17	2,34 %	
XS2051397961 - BN. GLENCORE FINANCE	200	99,91	T	199.478,00	0,00	199.478,00	100,24	199.258,00	1.212,43	200.470,43	0,31 %	992,43	0,50 %	11/06/2024
TOTAL MATERIAS PRIMAS						199.478,00				200.470,43	0,31 %	992,43	0,50 %	

(*) Indicativo de cambio/precio: P-Importe por título. T-Porcentaje del nominal. En Renta Fija siempre es ex-cupón.

Importe en Euros

Pensioval VII, F.P. (PP Personal Empleado Público)

de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

COMPOSICIÓN DE LA CARTERA		PATRIMONIO: 65.024.662,62					FECHA VALORACIÓN 31/08/2020							
Nombre del Valor	Nº. títulos	COSTE MEDIO DE ADQUISICIÓN				VALOR DE MERCADO					VARIACIÓN		Vencimiento	
		Cambio (*)	Ex-Cupón	Cup.	Coste Medio	Precio	Ex-Cupón	Cup.	Valor	% s/pal.	%			
XS2194282948 - OB. INFINEON	1	99,83	T	100.447,00	0,00	100.447,00	102,05	101.913,00	139,73	102.052,73	0,16 %	1.605,73	1,60 %	24/05/2023
XS2194283672 - OB. INFINEON	1	99,43	T	100.145,00	0,00	100.145,00	103,32	103.115,00	209,59	103.324,59	0,16 %	3.179,59	3,17 %	24/03/2026
TOTAL TECNOLOGIA						200.592,00				205.377,32	0,32 %	4.785,32	2,39 %	
TOTAL RENTA FIJA						32.316.171,53				32.602.048,51	50,14 %	285.876,98	0,88 %	
ES0113900J37 - AC. BANCO SANTANDER	57.951	4,85	P	281.049,40	0,00	281.049,40	1,86	107.951,12	0,00	107.951,12	0,17 %	-173.098,28	-61,59 %	
NL0011821202 - AC. ING GROEP (INGA NA)	18.125	13,35	P	242.026,42	0,00	242.026,42	6,80	123.322,50	0,00	123.322,50	0,19 %	-118.703,92	-49,05 %	
FR0000131104 - AC. BNP-PARIBAS (BNP FP)	7.834	57,30	P	448.876,48	0,00	448.876,48	36,57	286.450,21	0,00	286.450,21	0,44 %	-162.426,27	-36,19 %	
DE0008404005 - AC. ALLIANZ (ALV GR)	1.749	136,12	P	238.077,73	0,00	238.077,73	181,52	317.478,48	0,00	317.478,48	0,49 %	79.400,75	33,35 %	
FR0000120628 - AC. AXA (CS FP)	8.783	24,10	P	211.682,27	0,00	211.682,27	17,08	149.978,51	0,00	149.978,51	0,23 %	-61.703,76	-29,15 %	
IT0000072618 - AC. INTESA SANPAOLO (ISP)	52.219	1,43	P	74.514,97	0,00	74.514,97	1,81	94.265,74	0,00	94.265,74	0,14 %	19.750,77	26,51 %	
TOTAL FINANCIERO						1.496.227,27				1.079.446,56	1,66 %	-416.780,71	-27,86 %	
DE0005933956 - PT. ISHARES CORE EURO	8.828	33,98	P	299.934,89	0,00	299.934,89	33,28	293.751,70	0,00	293.751,70	0,45 %	-6.183,19	-2,06 %	
LU1650488494 - PT. LYXOR ETF EUR	10.408	151,50	P	1.576.841,7	0,00	1.576.841,77	154,71	1.610.221,68	0,00	1.610.221,68	2,48 %	33.379,91	2,12 %	
LU0490769915 - PT. HENDERSON	140.128	6,68	P	935.426,36	0,00	935.426,36	7,28	1.020.135,04	0,00	1.020.135,04	1,57 %	84.708,68	9,06 %	
LU0496786657 - PT. LYXOR ETF S&P 500	133.855	27,72	P	3.242.492,4	0,00	3.242.492,41	35,70	4.003.538,46	0,00	4.003.538,46	6,16 %	761.046,05	23,47 %	
IE00BN8SY486 - PT. BLACKSTONE	124.287	10,50	P	1.304.506,0	0,00	1.304.506,00	9,31	1.157.113,63	0,00	1.157.113,63	1,78 %	-147.392,37	-11,30 %	
LU0915363070 - PT. NORDEA 1 FLEXIBLE FI BI	5.844	111,17	P	649.649,91	0,00	649.649,91	114,57	669.518,67	0,00	669.518,67	1,03 %	19.868,76	3,06 %	
ES0107575039 - PT. ALTAMAR IX GLOBAL	195.851	1,17	P	228.997,96	0,00	228.997,96	1,40	274.583,47	0,00	274.583,47	0,42 %	45.585,51	19,91 %	
ES0113385035 - PT. BANKIA FUTURO	1.429	113,38	P	162.000,00	0,00	162.000,00	117,87	168.415,20	0,00	168.415,20	0,26 %	6.415,20	3,96 %	
LU1165135952 - PT. PARVEST AQUA-I EUR	722	193,23	P	139.572,35	0,00	139.572,35	229,09	165.474,46	0,00	165.474,46	0,25 %	25.902,11	18,56 %	
IE00B3K93X10 - PT. POLAR CAPITAL -	3.153	45,23	P	121.131,15	0,00	121.131,15	56,03	148.018,20	0,00	148.018,20	0,23 %	26.887,05	22,20 %	
LU0438336777 - PT. BLACKROCK SF- FIXED	10.537	124,18	P	1.308.499,5	0,00	1.308.499,56	128,65	1.355.600,49	0,00	1.355.600,49	2,08 %	47.100,93	3,60 %	

(*) Indicativo de cambio/precio: P-Importe por título. T-Porcentaje del nominal. En Renta Fija siempre es ex-cupón.

Importe en Euros

Pensioval VII, F.P. (PP Personal Empleado Público

de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

COMPOSICIÓN DE LA CARTERA		PATRIMONIO: 65.024.662,62					FECHA VALORACIÓN 31/08/2020							
Nombre del Valor	Nº. títulos	COSTE MEDIO DE ADQUISICIÓN					VALOR DE MERCADO					VARIACIÓN		Vencimiento
		Cambio (*)	Ex-Cupón	Cup.	Coste Medio	Precio	Ex-Cupón	Cup.	Valor	% s/pal.	%			
LU0955993034 - PT. ROBECO CAP GR-NEW	1.327	136,88	P	153.356,88	0,00	153.356,88	151,96	168.982,65	0,00	168.982,65	0,26 %	15.625,77	10,19 %	
LU0250161907 - PT. NN L GLOBAL EQUITY	26	10.427,69	P	267.929,07	0,00	267.929,07	12.207,44	313.657,97	0,00	313.657,97	0,48 %	45.728,90	17,07 %	
ES0161723004 - PT. MCH GLOBAL BUYOUT	79.062	0,89	P	70.000,00	0,00	70.000,00	0,85	66.886,16	0,00	66.886,16	0,10 %	-3.113,84	-4,45 %	
ES0157103047 - PT. ALTAMAR X GLOBAL	50.873	0,99	P	50.198,80	0,00	50.198,80	0,89	45.429,60	0,00	45.429,60	0,07 %	-4.769,20	-9,50 %	
LU1694214633 - PT. NORDEA 1- LOW	6.731	99,71	P	671.109,92	0,00	671.109,92	103,25	694.936,31	0,00	694.936,31	1,07 %	23.826,39	3,55 %	
PANTHEON0009 - PT. PANTHEON GLOBAL	53.824	1,00	P	47.829,57	0,00	47.829,57	1,09	49.282,65	0,00	49.282,65	0,08 %	1.453,08	3,04 %	
LU1681045453 - PT. AMUNDI MSCI EMERGING	294.933	4,58	P	1.200.238,2	0,00	1.200.238,22	4,98	1.229.348,74	0,00	1.229.348,74	1,89 %	29.110,52	2,43 %	
LU0151333506 - PT. CANDRIAM BONDS -	5.722	228,66	P	1.308.499,9	0,00	1.308.499,99	234,27	1.340.603,05	0,00	1.340.603,05	2,06 %	32.103,06	2,45 %	
LU1365052627 - PT. NN L - EURO GREEN	118	5.626,70	P	662.020,11	0,00	662.020,11	5.708,82	671.682,63	0,00	671.682,63	1,03 %	9.662,52	1,46 %	
IE00BG5QQB73 - PT. MGI FUNDS PLC -	3.409	97,84	P	297.976,93	0,00	297.976,93	110,76	316.299,16	0,00	316.299,16	0,49 %	18.322,23	6,15 %	
LU2122467942 - PT. VONTOBEL FUND -	15.188	94,05	P	1.232.368,9	0,00	1.232.368,93	96,06	1.222.324,79	0,00	1.222.324,79	1,88 %	-10.044,14	-0,82 %	
TOTAL INVERSIÓN						15.930.580,78		16.985.804,71		26,12 %		1.055.223,93	6,62 %	
FR0000125486 - AC. VINCI (DG FP)	2.131	72,41	P	154.295,07	0,00	154.295,07	78,58	167.453,98	0,00	167.453,98	0,26 %	13.158,91	8,53 %	
TOTAL CONSTRUCCIÓN						154.295,07		167.453,98		0,26 %		13.158,91	8,53 %	
ES0144580Y14 - AC. IBERDROLA, S.A (IBE SM)	14.529	8,56	P	124.333,67	0,00	124.333,67	10,55	153.280,95	0,00	153.280,95	0,24 %	28.947,28	23,28 %	
DE000ENAG999 - AC. E.ON (EOAN GR)	20.252	7,24	P	146.630,34	0,00	146.630,34	9,91	200.697,32	0,00	200.697,32	0,31 %	54.066,98	36,87 %	
IT0003128367 - AC. ENEL (ENEL IM)	37.114	4,11	P	152.532,10	0,00	152.532,10	7,59	281.658,15	0,00	281.658,15	0,43 %	129.126,05	84,66 %	
TOTAL ELÉCTRICAS						423.496,11		635.636,42		0,98 %		212.140,31	50,09 %	
FR0000120644 - AC. DANONE (BN FP)	2.491	62,33	P	155.253,87	0,00	155.253,87	55,10	137.254,10	0,00	137.254,10	0,21 %	-17.999,77	-11,59 %	
NL0011794037 - AC. KONINKLIJKE AHOLD	8.446	19,83	P	167.455,43	0,00	167.455,43	25,22	213.008,12	0,00	213.008,12	0,33 %	45.552,69	27,20 %	
BE0974293251 - AC. ANHEUSER-BUSCH	2.356	98,93	P	233.067,28	0,00	233.067,28	48,81	114.984,58	0,00	114.984,58	0,18 %	-118.082,70	-50,66 %	
TOTAL ALIMENTACIÓN						555.776,58		465.246,80		0,72 %		-90.529,78	-16,29 %	

(*) Indicativo de cambio/precio: P-Importe por título. T-Porcentaje del nominal. En Renta Fija siempre es ex-cupón.

Importe en Euros

Pensioval VII, F.P. (PP Personal Empleado Público

de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

COMPOSICIÓN DE LA CARTERA		PATRIMONIO: 65.024.662,62					FECHA VALORACIÓN 31/08/2020							
Nombre del Valor	Nº. títulos	COSTE MEDIO DE ADQUISICIÓN				VALOR DE MERCADO					VARIACIÓN		Vencimiento	
		Cambio (*)	Ex-Cupón	Cup.	Coste Medio	Precio	Ex-Cupón	Cup.	Valor	% s/pal.	%			
DE0007236101 - AC. SIEMENS (SIE GR)	3.862	116,53	P	450.051,10	0,00	450.051,10	115,66	446.678,92	0,00	446.678,92	0,69 %	-3.372,18	-0,75 %	
FR0000125007 - AC. COMPAGNIE DE SAINT	3.379	44,18	P	149.295,62	0,00	149.295,62	33,98	114.818,42	0,00	114.818,42	0,18 %	-34.477,20	-23,09 %	
DE0005190003 - AC. BMW (BMW GR)	1.566	89,09	P	139.512,49	0,00	139.512,49	60,15	94.194,90	0,00	94.194,90	0,14 %	-45.317,59	-32,48 %	
DE0007100000 - AC. DAIMLER (DAI GR)	3.480	67,14	P	233.649,44	0,00	233.649,44	42,65	148.404,60	0,00	148.404,60	0,23 %	-85.244,84	-36,48 %	
FR0000121972 - AC. SCHNEIDER ELECTRIC	3.157	71,27	P	224.983,11	0,00	224.983,11	103,75	327.538,75	0,00	327.538,75	0,50 %	102.555,64	45,58 %	
DK0010244508 - AC. AP MOELLER- MAERSK-	280	7.732,35	P	290.028,21	0,00	290.028,21	9.564,00	359.756,57	0,00	359.756,57	0,55 %	69.728,36	24,04 %	
TOTAL INDUSTRIAL						1.487.519,97				1.491.392,16	2,29 %	3.872,19	0,26 %	
FR0000120271 - AC. TOTAL (FP FP)	8.756	48,18	P	421.850,17	0,00	421.850,17	33,10	289.823,60	0,00	289.823,60	0,45 %	-132.026,57	-31,30 %	
IT0003132476 - AC. ENI (ENI IM)	5.941	16,74	P	99.463,66	0,00	99.463,66	7,80	46.339,80	0,00	46.339,80	0,07 %	-53.123,86	-53,41 %	
TOTAL PETRÓLEO						521.313,83				336.163,40	0,52 %	-185.150,43	-35,52 %	
DE000BASF111 - AC. BASF SE (BAS GR)	3.856	86,27	P	332.662,77	0,00	332.662,77	51,06	196.887,36	0,00	196.887,36	0,30 %	-135.775,41	-40,81 %	
FR0000120578 - AC. SANOFI (SAN FP)	5.388	76,41	P	411.678,97	0,00	411.678,97	84,87	457.279,56	0,00	457.279,56	0,70 %	45.600,59	11,08 %	
FR0000121667 - AC. ESSILOR	1.474	103,74	P	152.916,94	0,00	152.916,94	112,10	165.235,40	0,00	165.235,40	0,25 %	12.318,46	8,06 %	
TOTAL QUIMICO						897.258,68				819.402,32	1,26 %	-77.856,36	-8,68 %	
FR0000127771 - AC. VIVENDI (VIV FP)	3.117	19,78	P	61.656,47	0,00	61.656,47	23,80	74.184,60	0,00	74.184,60	0,11 %	12.528,13	20,32 %	
DE0005557508 - AC. DEUTSCHE TELEKOM	15.963	16,11	P	257.215,38	0,00	257.215,38	14,75	235.454,25	0,00	235.454,25	0,36 %	-21.761,13	-8,46 %	
FR0000133308 - AC. ORANGE (ORA FP)	10.934	14,42	P	157.700,28	0,00	157.700,28	9,33	102.014,22	0,00	102.014,22	0,16 %	-55.686,06	-35,31 %	
TOTAL COMUNICACIÓN						476.572,13				411.653,07	0,63 %	-64.919,06	-13,62 %	
FR0000121014 - AC. LVMH MOET HENNESSY	1.414	183,57	P	259.566,54	0,00	259.566,54	392,80	555.419,20	0,00	555.419,20	0,85 %	295.852,66	113,9 %	
DE0005439004 - AC. CONTINENTAL (CON GR)	931	119,49	P	111.241,82	0,00	111.241,82	91,20	84.907,20	0,00	84.907,20	0,13 %	-26.334,62	-23,67 %	
IT0005278236 - AC. PIRELLI & C. (PIRC IM)	13.024	5,75	P	74.873,66	0,00	74.873,66	3,62	47.159,90	0,00	47.159,90	0,07 %	-27.713,76	-37,01 %	
ES0148396007 - AC. INDITEX (ITX SM)	6.053	27,74	P	167.900,80	0,00	167.900,80	23,55	142.548,15	0,00	142.548,15	0,22 %	-25.352,65	-15,10 %	

(*) Indicativo de cambio/precio: P-Importe por título. T-Porcentaje del nominal. En Renta Fija siempre es ex-cupón.

Importe en Euros

Pensioval VII, F.P. (PP Personal Empleado Público

de 2020

PP para el Personal Empleado Público de la Generalitat

COMPOSICIÓN DE LA CARTERA		PATRIMONIO: 65.024.662,62					FECHA VALORACIÓN 31/08/2020							
Nombre del Valor	Nº. títulos	COSTE MEDIO DE ADQUISICIÓN				VALOR DE MERCADO					VARIACIÓN		Vencimiento	
		Cambio (*)	Ex-Cupón	Cup.	Coste Medio	Precio	Ex-Cupón	Cup.	Valor	% s/pal.	%			
FR0000131906 - AC. RENAULT SA (RNO FP)	5.073	58,32	P	295.849,52	0,00	295.849,52	23,84	120.940,32	0,00	120.940,32	0,19 %	-174.909,20	-59,12 %	
TOTAL DISTRIBUCION						909.432,34				950.974,77	1,46 %	41.542,43	4,57 %	
ES0105223004 - AC. GESTAMP AUTOMOCION	24.392	5,65	P	137.681,34	0,00	137.681,34	2,24	54.686,86	0,00	54.686,86	0,08 %	-82.994,48	-60,28 %	
TOTAL OTRAS INDUSTRIAS Y SERVICIOS						137.681,34				54.686,86	0,08 %	-82.994,48	-60,28 %	
DE0007164600 - AC. SAP (SAP GR)	4.142	83,47	P	345.719,20	0,00	345.719,20	138,04	571.761,68	0,00	571.761,68	0,88 %	226.042,48	65,38 %	
FI0009000681 - AC. NOKIA (NOKIA FH)	16.800	4,39	P	73.744,53	0,00	73.744,53	4,07	68.418,00	0,00	68.418,00	0,11 %	-5.326,53	-7,22 %	
NL0010273215 - AC. ASML HOLDING (ASML	1.615	108,20	P	174.748,99	0,00	174.748,99	314,30	507.594,50	0,00	507.594,50	0,78 %	332.845,51	190,4 %	
US30303M1027 - AC. FACEBOOK - A (FB US)	1.151	179,66	P	191.135,77	0,00	191.135,77	293,20	282.735,59	0,00	282.735,59	0,43 %	91.599,82	47,92 %	
TOTAL TECNOLOGIA						785.348,49				1.430.509,77	2,20 %	645.161,28	82,15 %	
TOTAL RENTA VARIABLE						23.775.502,59				24.828.370,82	38,18 %	1.052.868,23	4,43 %	
TOTAL CARTERA DE VALORES						56.091.674,12				57.430.419,33	88,32 %	1.338.745,21	2,39 %	

(*) Indicativo de cambio/precio: P-Importe por título. T-Porcentaje del nominal. En Renta Fija siempre es ex-cupón.

Importe en Euros

Bankia
pensiones >