

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017

PP de los Empleados de la Generalitat

A photograph of an elderly man with a beard, wearing a plaid shirt and light-colored trousers, sitting in a dark wooden chair in a garden. He 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 strong lens flare effect.

Bankia
pensiones >

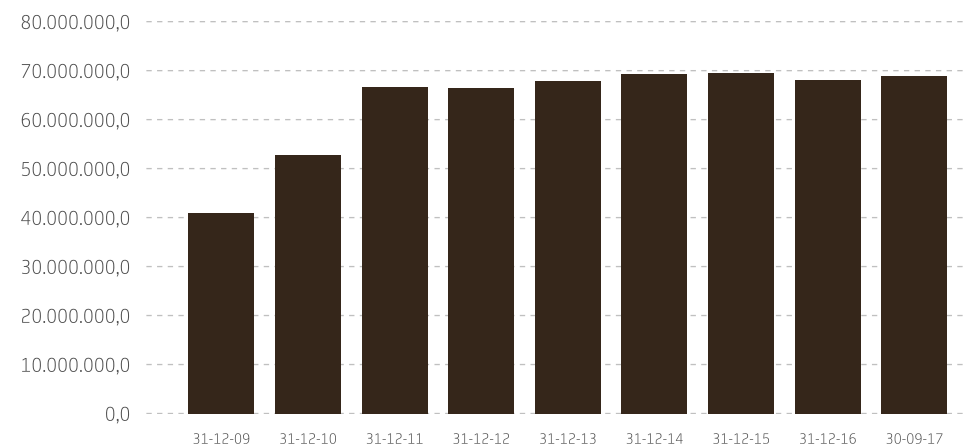
1. Evolución de las principales magnitudes del Fondo

1.1 Patrimonio y partícipes

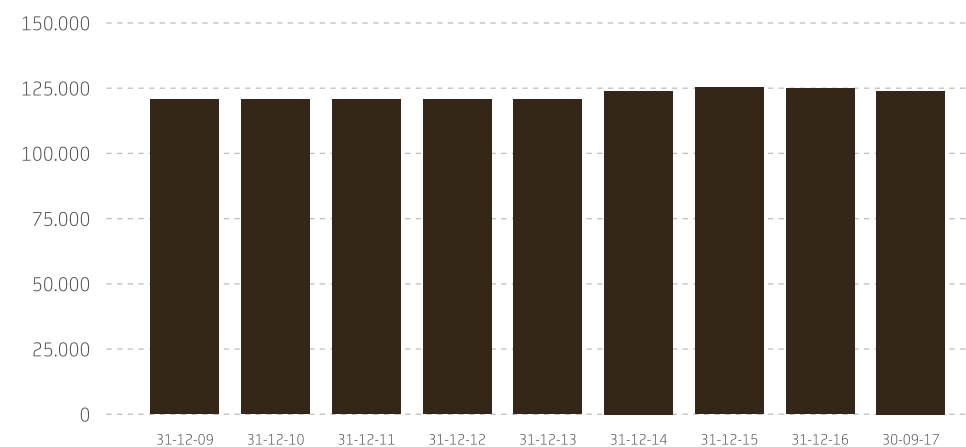
| FECHA | PATRIMONIO | PARTICIPES |
|-------------|--------------|------------|
| 31-dic-2009 | 40.879.599,6 | 120.608 |
| 31-dic-2010 | 52.680.015,1 | 120.608 |
| 31-dic-2011 | 66.599.159,1 | 120.608 |
| 31-dic-2012 | 66.536.926,2 | 120.608 |
| 31-dic-2013 | 67.837.274,8 | 120.608 |
| 31-dic-2014 | 69.300.223,0 | 123.934 |
| 31-dic-2015 | 69.608.705,5 | 125.245 |
| 31-dic-2016 | 68.112.033,1 | 124.931 |
| 30-sep-2017 | 68.954.786,5 | 123.923 |

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

Evolución del patrimonio



Evolución de partícipes



2. Evolución de las principales magnitudes del Plan

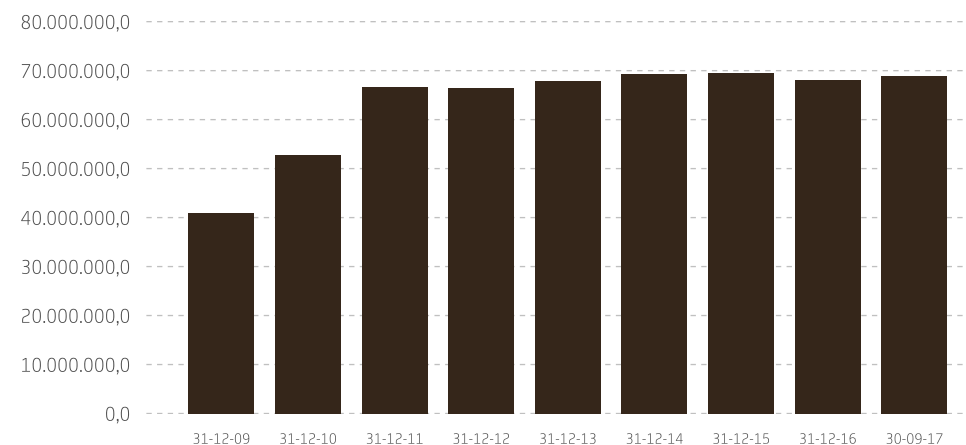
2.1 Patrimonio Participes y Beneficiarios

| FECHA | PATRIMONIO | ACTIVOS | PARTICIPES | | BENEFICIARIOS |
|-------------|--------------|---------|------------|---------|---------------|
| | | | SUSPENSO | TOTALES | |
| 31-dic-2009 | 40.879.599,6 | 2.284 | 117.534 | 119.818 | 790 |
| 31-dic-2010 | 52.680.015,1 | 2.284 | 117.534 | 119.818 | 790 |
| 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 |
| 30-sep-2017 | 68.954.786,5 | 177 | 121.644 | 121.821 | 2.102 |

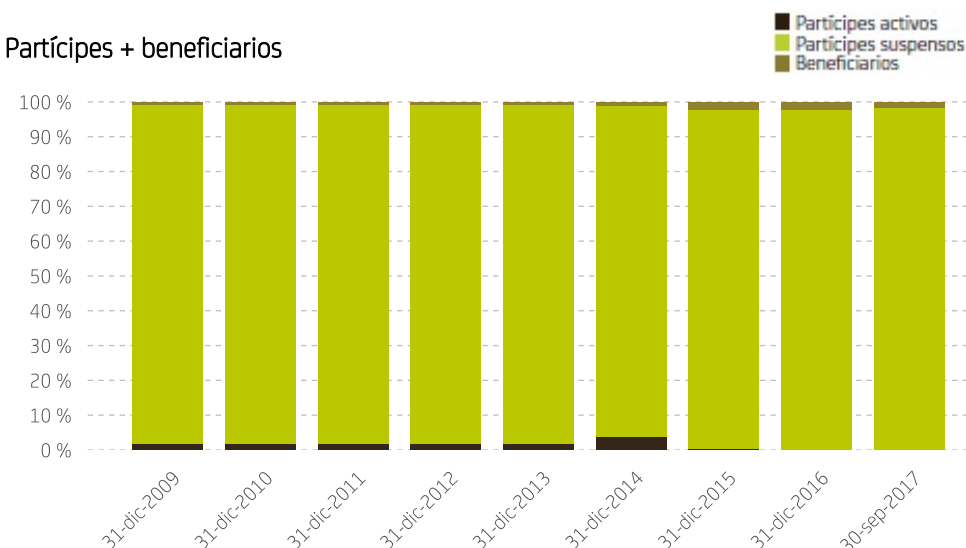
Movimientos del plan

| | MES ACTUAL |
|-------------------------|------------|
| Aportaciones Participes | 84,4 |
| Contribuciones Promotor | 0,6 |
| Movilizaciones Netas | 108,5 |
| Prestaciones | 1.477,4 |

Evolución del patrimonio



Participes + beneficiarios



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

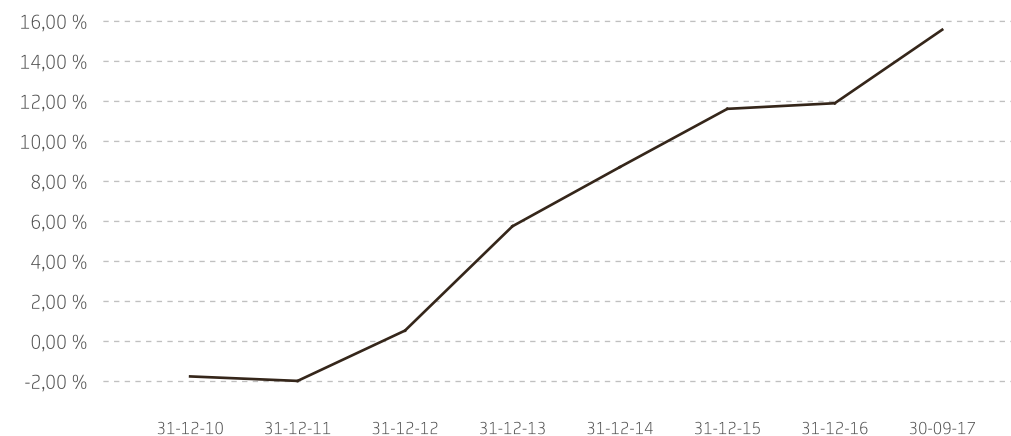
3. Rentabilidades del Plan

3.1 Rentabilidades históricas

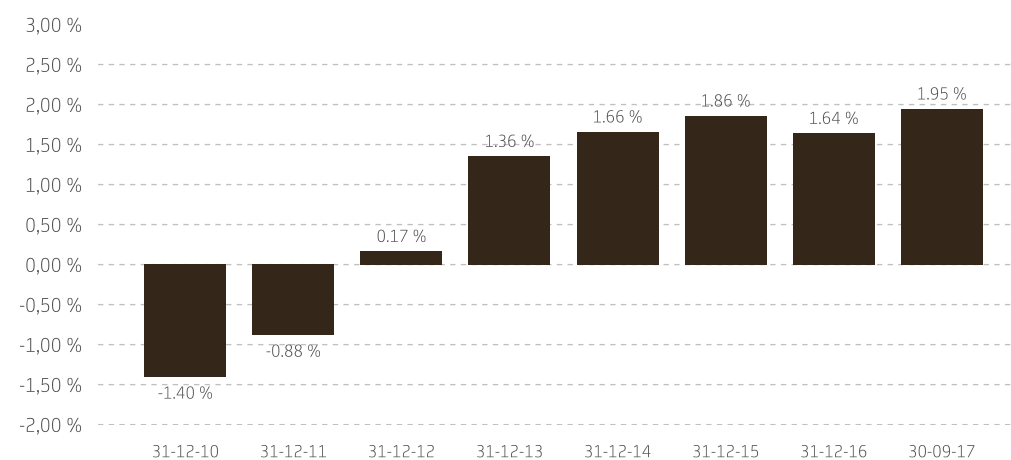
| Fecha | VLP | Rentabilidad Mensual | Rentabilidad Interanual | Rent. Histór. Acumulada | Rent. Histór. Anualizada |
|-----------|-----------|----------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| 31-dic-12 | 10,054579 | 0,49 % | 2,57 % | 0,55 % | 0,17 % |
| 31-dic-13 | 10,575988 | 0,20 % | 5,19 % | 5,76 % | 1,36 % |
| 31-dic-14 | 10,871830 | -0,41 % | 2,80 % | 8,72 % | 1,66 % |
| 31-dic-15 | 11,162896 | -1,44 % | 2,68 % | 11,63 % | 1,86 % |
| 31-dic-16 | 11,191119 | 1,50 % | 0,25 % | 11,91 % | 1,64 % |
| 31-ene-17 | 11,171697 | -0,17 % | 1,96 % | 11,72 % | 1,60 % |
| 28-feb-17 | 11,267983 | 0,86 % | 3,26 % | 12,68 % | 1,71 % |
| 31-mar-17 | 11,353476 | 0,76 % | 3,29 % | 13,53 % | 1,80 % |
| 30-abr-17 | 11,406079 | 0,46 % | 3,85 % | 14,06 % | 1,85 % |
| 31-may-17 | 11,476084 | 0,61 % | 3,56 % | 14,76 % | 1,93 % |
| 30-jun-17 | 11,414820 | -0,53 % | 3,74 % | 14,15 % | 1,83 % |
| 31-jul-17 | 11,462496 | 0,42 % | 3,08 % | 14,62 % | 1,87 % |
| 31-ago-17 | 11,454588 | -0,07 % | 3,04 % | 14,55 % | 1,84 % |
| 30-sep-17 | 11,558537 | 0,91 % | 4,03 % | 15,59 % | 1,95 % |

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

Evolución rentabilidad acumulada



Evolución de rentabilidad histórica anualizada

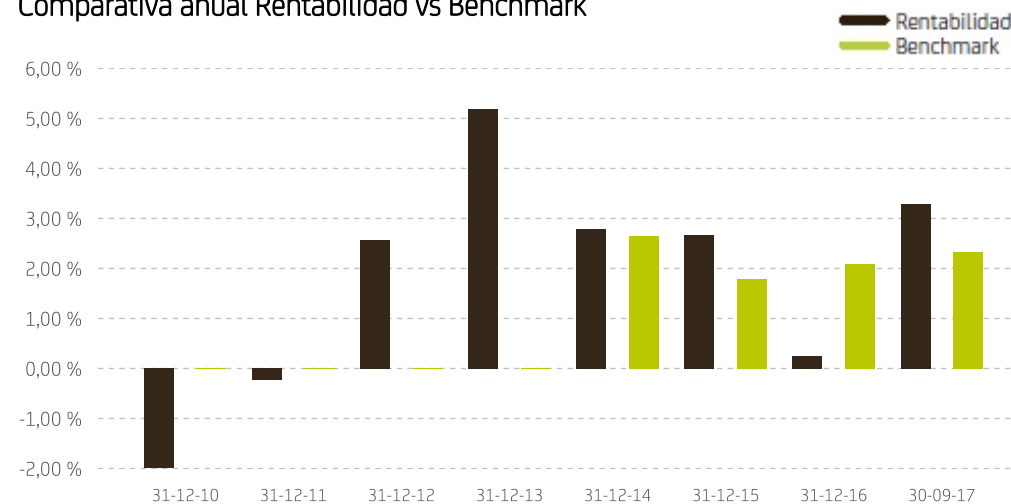


3. Rentabilidades del Plan

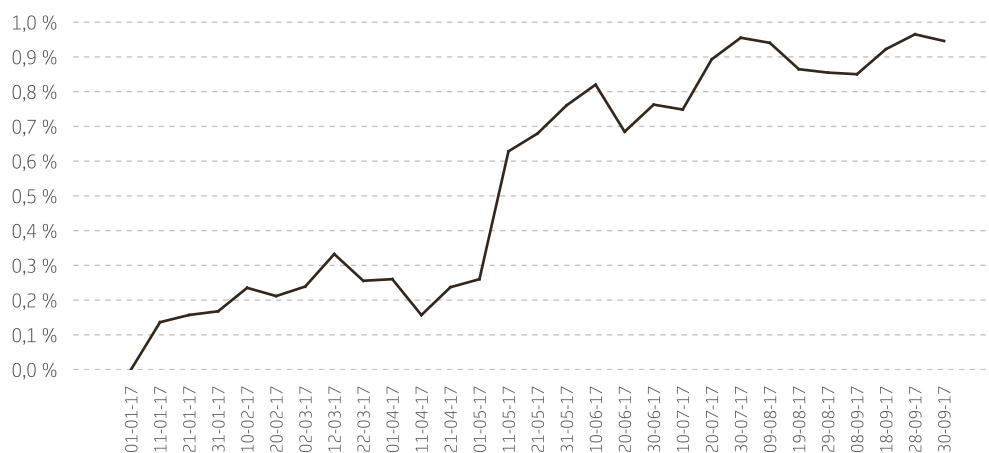
3.2 Rentabilidad vs Benchmark

| FECHA | RENTABILIDAD | BENCHMARK |
|-----------|--------------|-----------|
| 31-dic-10 | -2,00 % | |
| 31-dic-11 | -0,23 % | |
| 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 % |
| 30-sep-17 | 3,28 % | 2,33 % |

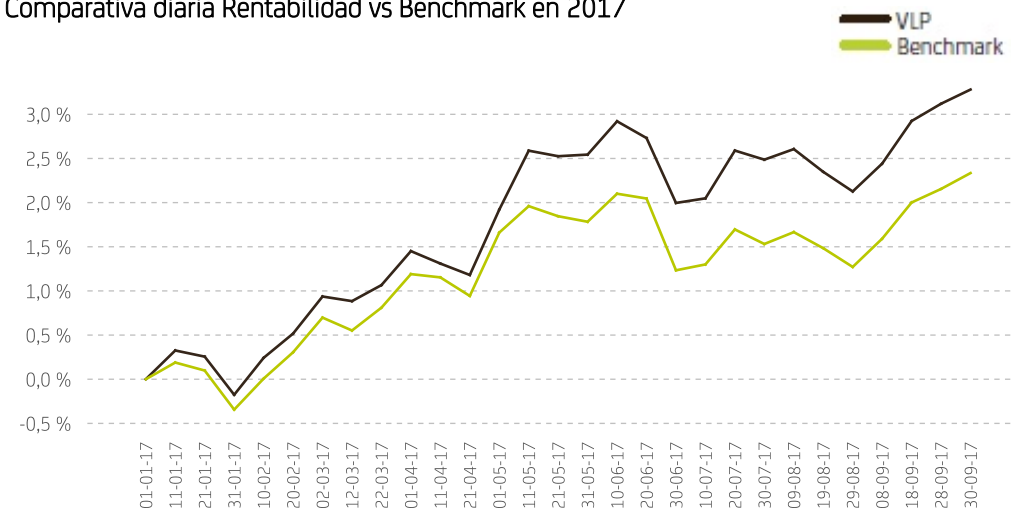
Comparativa anual Rentabilidad vs Benchmark



Diferencial diario Rentabilidad vs Benchmark en 2017



Comparativa diaria Rentabilidad vs Benchmark en 2017



Septiembre ha transcurrido con buen comportamiento por parte de los mercados de valores. Esto, que puede parecer anodino, resulta mucho más interesante poniéndolo en perspectiva, ya que éste es un mes tradicionalmente desfavorable para los mercados.

La contribución por parte del petróleo ha sido clara: 10% de subida de los precios del crudo durante el mes, sin duda alguna, favorecida por el impacto de los huracanes en el Golfo de México.

A nivel macro, hemos visto que los datos positivos a uno y otro lado del Atlántico han mejorado la percepción del inversor. Así, en la Unión Europea veíamos datos de confianza de los agentes de la UEM más altos de lo esperado, y lo mismo ocurría con los pedidos de bienes duraderos en USA.

Como consecuencia de todo ello, las bolsas subieron de forma significativa a nivel mundial. En Europa se registró el mejor comportamiento, y el Eurostoxx-50 subió más del 5% en el mes. El S&P 500, registró una moderada subida del 2%, pero lleva meses batiendo máximos históricos. El Ibex, por su parte, registró una tímida subida del 1%, pero cabe mencionar que el mercado español tiene sus propios temores.

La renta fija ha registrado caídas de precios en Europa, y tanto Alemania como España tuvieron comportamientos similares. En Estados Unidos fue donde se registró una caída más abultada, ya que las expectativas de subidas de tipos por parte de la FED no han hecho más que aumentar en los últimos días.

El dólar cotiza a 1.17 por euro, lo que ha mitigado la visión de que podríamos ver pronto una depreciación de la moneda americana que le situase por encima de 1.20.

En España y Europa resta ver el efecto del referéndum catalán y las implicaciones que tiene. Esperemos que Octubre sea un mes tranquilo... al menos a ese respecto.

5. Composición de la cartera de inversiones

5.1 Por clases de activos

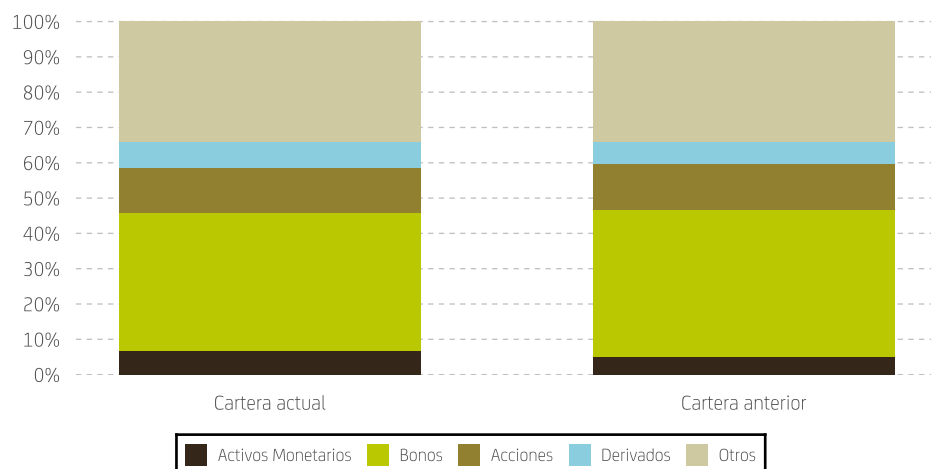
| CLASE DE ACTIVO | CARTERA ACTUAL | | CARTERA ANTERIOR | |
|-----------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------|
| | CUANTÍA | % | CUANTÍA | % |
| Activos Monetarios | 4.851.142 | 6,55 % | 3.570.868 | 4,91 % |
| Bonos | 29.164.267 | 39,37 % | 30.441.241 | 41,84 % |
| IIC's Renta Fija | 17.488.622 | 23,61 % | 17.454.507 | 23,99 % |
| Total Renta Fija | 51.504.031 | 69,52 % | 51.466.616 | 70,73 % |
| Acciones | 9.439.994 | 12,74 % | 9.467.573 | 13,01 % |
| IIC's Renta Variable | 4.277.867 | 5,77 % | 3.882.311 | 5,34 % |
| Efecto Derivados RV | 5.384.053 | 7,27 % | 4.484.219 | 6,16 % |
| Total Renta Variable | 19.101.915 | 25,78 % | 17.834.103 | 24,51 % |
| Otros | 3.478.431 | 4,70 % | 3.462.881 | 4,76 % |
| TOTAL CARTERA | 74.084.377 | 100,00 % | 72.763.601 | 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



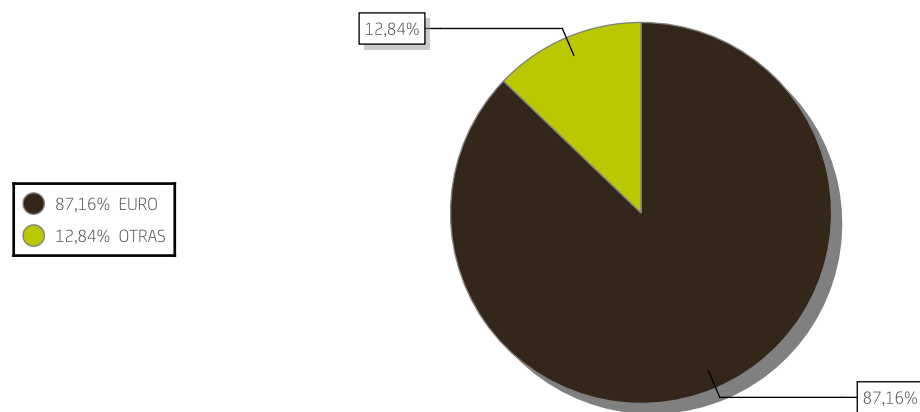
5. Composición de la cartera de inversiones

5.2 Por riesgo divisa

| DIVISA | CARTERA ACTUAL | | CARTERA ANTERIOR | |
|---------------------|-------------------|-----------------|-------------------|-----------------|
| | CUANTÍA | % | CUANTÍA | % |
| EURO | 61.890.800 | 87,16 % | 61.924.219 | 90,69 % |
| USD Dólar USA | 8.969.059 | 12,63 % | 5.661.637 | 8,29 % |
| JPY Yen Japonés. | 89.769 | 0,13 % | 695.467 | 1,02 % |
| GBP Libra Esterlina | 57.433 | 0,08 % | -2.371 | 0,00 % |
| CHF Franco Suizo | 429 | 0,00 % | 430 | 0,00 % |
| TOTAL | 71.007.490 | 100,00 % | 68.279.382 | 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".

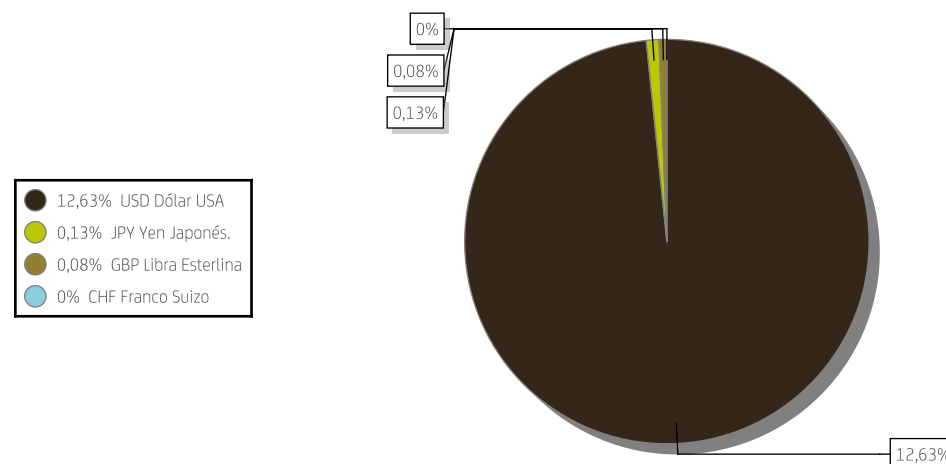
Distribución por riesgo divisa



Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

| DESGLOSE DE DERIVADOS | CARTERA ACTUAL | | | | |
|-------------------------------------|----------------|-------|----------------------|-----|----------------|
| | POS | CONTR | CUANTÍA | DIV | % |
| FUT. EURO/JAPANESE YEN VTO. DEC 17 | P.C. | 5 | -626.554,49 | JPY | -0,88 % |
| FUT. EURO E-MINI VTO. DEC 17 (EEZ7) | P.C. | 7 | -439.779,62 | USD | -0,62 % |
| FUT. EURO / GBP VTO. DEC 17 (RPZ7) | P.C. | 2 | -250.468,11 | GBP | -0,35 % |
| TOTAL | | | -1.316.802,22 | | -1,85 % |

Desglose otras divisas



6. Composición de la cartera de renta fija contado

6.1 Por plazos y rating

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

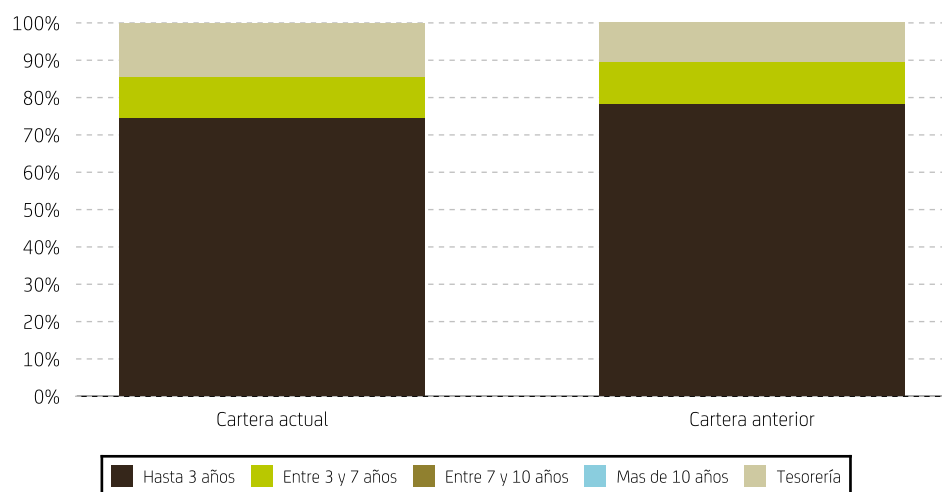
| PLAZOS | CARTERA ACTUAL | | | | CARTERA ANTERIOR | | | |
|------------------|-------------------|-----------------|-------------|----------------|-------------------|-----------------|-------------|----------------|
| | CUANTÍA | % | DURACIÓN | SENSIB. | CUANTÍA | % | DURACIÓN | SENSIB. |
| Hasta 3 años | 25.402.758 | 74,68 % | 1,58 | 398.146 | 26.674.224 | 78,43 % | 1,63 | 429.850 |
| Entre 3 y 7 años | 3.761.509 | 11,06 % | 3,65 | 134.436 | 3.767.018 | 11,08 % | 3,73 | 137.827 |
| Tesorería | 4.851.142 | 14,26 % | 0,00 | 133 | 3.570.868 | 10,50 % | 0,00 | 228 |
| TOTAL | 34.015.409 | 100,00 % | 1,59 | 532.715 | 34.012.110 | 100,00 % | 1,69 | 567.905 |

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.

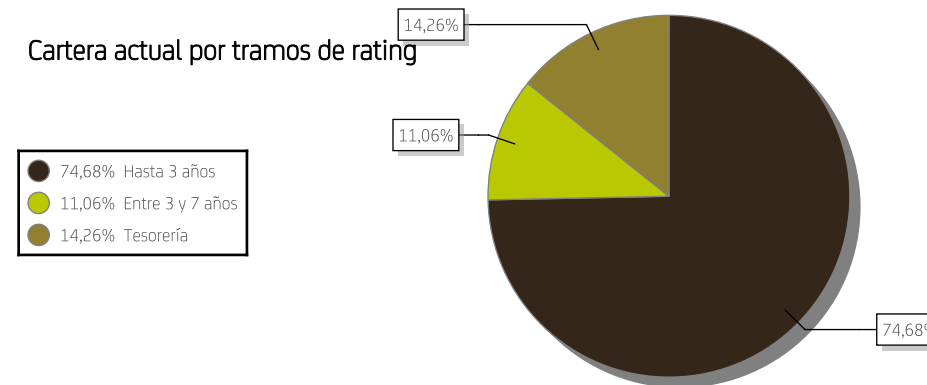
Evolución de la cartera



| RATING | CARTERA ACTUAL | | |
|--------------|-------------------|-----------------|-------------|
| | CUANTÍA | % | % ACUMULADO |
| BBB | 29.164.267 | 100,00 % | 100,00 % |
| TOTAL | 29.164.267 | 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 2.75% VTO. 04/19 | 7.341.701 | 14,25 % | BBB+ |
| BN. ESTADO ITALIANO 2.50% VTO. 05/19 | 5.066.402 | 9,84 % | BBB |
| OB. ESTADO ITALIANO 4.25% VTO. 09/19 | 2.841.911 | 5,52 % | BBB |
| OB. ESTADO 0.75% VTO. 07/21 | 2.722.912 | 5,29 % | BBB+ |
| BN. ESTADO 1.15% VTO. 07/20 | 2.686.978 | 5,22 % | BBB+ |
| BN. SANTANDER CONSUMER FIN. 1.1% | 1.417.428 | 2,75 % | BBB+ |
| BN. VODAFONE GROUP VTO. 02/19 | 1.316.316 | 2,56 % | BBB+ |
| OB. ESTADO 4.30% VTO. 10/19 | 1.133.918 | 2,20 % | BBB+ |
| BN. FADE 3.375% VTO. 03/19 | 963.167 | 1,87 % | BBB+ |
| OB. ESTADO 4.10% VTO. 07/18 | 730.131 | 1,42 % | BBB+ |
| BN. BANKINTER 1.75% VTO. 06/19 | 725.277 | 1,41 % | BBB |
| BN. ENEL 4.875% VTO. 02/18 | 618.958 | 1,20 % | BBB |
| CED. AYT CAJA GLOBAL 4% VTO. 03/21 | 578.136 | 1,12 % | BBB+ |
| OB. TELEFONICA EMISIONES 3.961% VTO. | 460.461 | 0,89 % | BBB |
| OB. COMUNIDAD MADRID 4.688% VTO. | 455.754 | 0,88 % | BBB+ |

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

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

| DESGLOSE DE DERIVADOS | CARTERA ACTUAL | | | | |
|-------------------------------|----------------|-------|---------------|-----|---------|
| | POS | CONTR | CUANTÍA | DIV | % |
| TOTAL | | | 0,00 | | 0,00 % |
| TOTAL EXPOSICIÓN A RENTA FIJA | | | 51.504.031,10 | | 69,52 % |

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

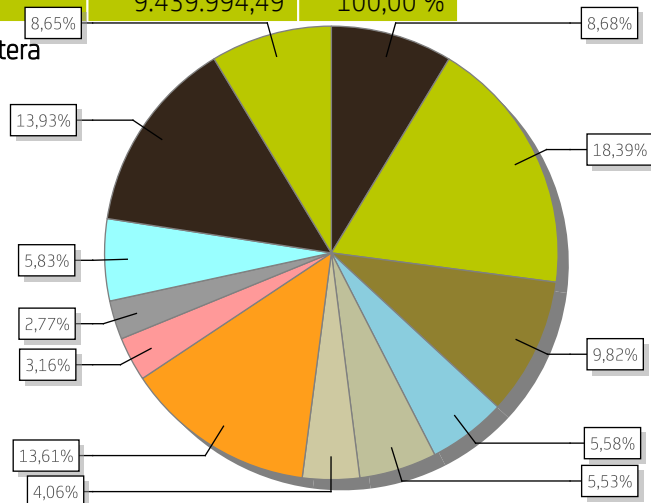
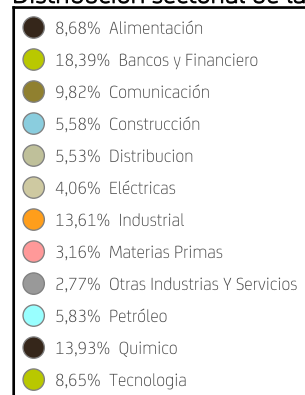
7.1 Desglose sectorial y desglose geográfico

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

| SECTOR | CARTERA ACTUAL | |
|------------------------------|---------------------|-----------------|
| | CUANTÍA | % |
| Alimentación | 819.134,03 | 8,68 % |
| Bancos y Financiero | 1.735.961,17 | 18,39 % |
| Comunicación | 926.920,18 | 9,82 % |
| Construcción | 527.202,73 | 5,58 % |
| Distribucion | 522.205,43 | 5,53 % |
| Eléctricas | 383.028,98 | 4,06 % |
| Industrial | 1.285.047,55 | 13,61 % |
| Materias Primas | 298.034,79 | 3,16 % |
| Otras Industrias Y Servicios | 261.379,31 | 2,77 % |
| Petróleo | 550.258,51 | 5,83 % |
| Químico | 1.314.554,12 | 13,93 % |
| Tecnología | 816.267,69 | 8,65 % |
| TOTAL | 9.439.994,49 | 100,00 % |

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

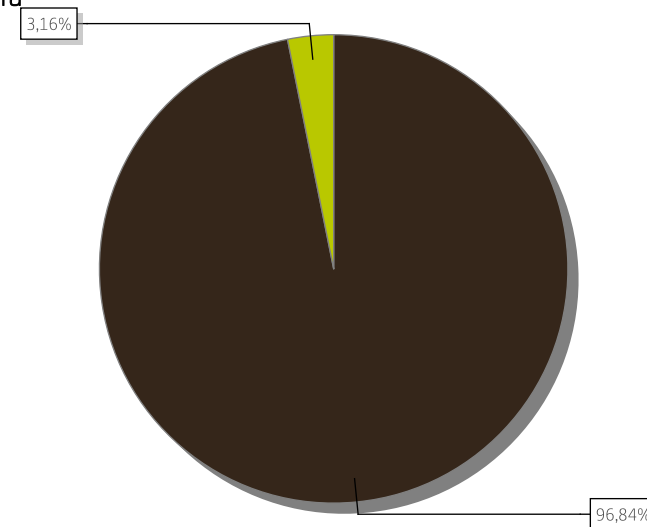
Distribución sectorial de la cartera



| ÁREA GEOGRÁFICA | CARTERA ACTUAL | |
|------------------------------|---------------------|-----------------|
| | CUANTÍA | % |
| Acc. Unión Europea Zona Euro | 9.141.959,70 | 96,84 % |
| Acc. Unión Europea No Euro | 298.034,79 | 3,16 % |
| TOTAL | 9.439.994,49 | 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 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

| ACTIVOS DE RENTA VARIABLE | CARTERA ACTUAL | |
|--------------------------------------|----------------|--------|
| | CUANTÍA | % |
| AC. SIEMENS (SIE GR) | 460.350,40 | 2,41 % |
| AC. SANOFI (SAN FP) | 452.645,88 | 2,37 % |
| AC. SAP (SAP GR) | 383.921,98 | 2,01 % |
| AC. BAYER AG (BAYN GR) | 360.312,50 | 1,89 % |
| AC. TOTAL (FP FP) | 359.424,51 | 1,88 % |
| AC. BASF SE (BAS GR) | 347.194,24 | 1,82 % |
| AC. BNP-PARIBAS (BNP FP) | 346.095,75 | 1,81 % |
| AC. FERROVIAL (FER SM) | 345.177,13 | 1,81 % |
| AC. BANCO SANTANDER (SAN SM) | 337.189,28 | 1,77 % |
| AC. ALLIANZ (ALV GR) | 332.222,55 | 1,74 % |
| AC. LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON | 330.098,30 | 1,73 % |
| AC. TELEFONICA (TEF SM) | 307.711,39 | 1,61 % |
| AC. RIO TINTO (RIO LN) | 298.034,79 | 1,56 % |
| AC. LOREAL (OR FP) | 286.041,00 | 1,50 % |
| AC. ING GROEP (INGA NA) | 282.750,00 | 1,48 % |

| OTROS ACTIVOS | CARTERA ACTUAL | |
|---------------------|------------------|---------------|
| | CUANTÍA | % |
| Inversión Indirecta | 63.367,50 | 0,67 % |
| TOTAL | 63.367,50 | 0,67 % |

| DESGLOSE DE DERIVADOS | CARTERA ACTUAL | | | | |
|--|----------------|-------|----------------------|-----|----------------|
| | POS | CONTR | CUANTÍA | DIV | % |
| FUT. S & P 500 EMINI VTO. DEC 17 | P.C. | 34 | 3.623.968,48 | USD | 18,97 % |
| FUT. DJ EURO STOXX 50 VTO. DEC 17 | P.C. | 31 | 1.108.560,00 | EUR | 5,80 % |
| FUT. EUROSTOXX BANK VTO. DEC 17 | P.C. | 145 | 997.600,00 | EUR | 5,22 % |
| FUT. IBEX MINI VTO. OCT 17 (IDV7) | P.V. | 95 | -981.445,00 | EUR | -5,14 % |
| FUT. STOXX 600 HEALTHCARE VTO. | P.C. | 13 | 486.980,00 | EUR | 2,55 % |
| FUT. EUROSTOXX INSURANCE VTO. | P.C. | 11 | 148.390,00 | EUR | 0,78 % |
| TOTAL | | | 5.384.053,48 | | 28,19 % |
| TOTAL EXPOSICIÓN A RENTA VARIABLE | | | 19.101.915,29 | | 25,78 % |

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

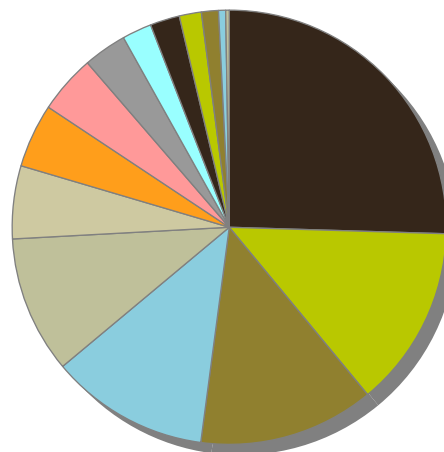
Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

| FONDO | CARTERA ACTUAL | |
|--|-------------------|----------------|
| | CUANTÍA | % |
| PT. EVLI SHORT CORPORATE BOND IB EUR (EVLEIBE FH) | 1.853.800 | 2,50 % |
| PT. BLACKROCK GF- EMERGING MARKET LOCAL \$ I2 (BGLEMI2 LX) | 1.808.412 | 2,44 % |
| PT. JB MULTIBOND- LOCAL EMERGING BOND FUND- C (JBLEMBC LX) | 1.497.951 | 2,02 % |
| PT. DWS FLOATING RATES NOTES (RENDGAR LX) | 1.372.454 | 1,85 % |
| PT. GENERALI INV SICAV- EURO CORP S/T BOND- GX (GSTECGX LX) | 1.345.299 | 1,82 % |
| PT. AMUNDI - AMUNDI 12M- I (AMTR12I FP) | 1.168.901 | 1,58 % |
| PT. MUZINICH ENHANCEDYIELD SHORT-TERM FUND ¿ACC (MUZESTE ID) | 1.130.066 | 1,53 % |
| PT. UBAM-CORPORATE USD BD-IHCE (UBCIHCE LX) | 1.109.199 | 1,50 % |
| PT. PIMCO US - HIGH YIELD BOND FUND - ¿ (PIMHYIU ID) | 1.070.960 | 1,45 % |
| PT. LORD ABBETT PASSPORT PORT-HIGH YIELD FUND ¿ (LAHYEIH ID) | 1.067.703 | 1,44 % |
| TOTAL | 13.424.745 | 18,12 % |

NOTA: Los porcentajes están calculados sobre el patrimonio.

Desglose por activos

| | |
|---|--|
| ● | 17,36% R.F.EURO Crédito |
| ● | 9,22% IIC DE RETORNO ABSOLUTO Retorno Absoluto |
| ● | 8,92% R.F.I. RF emergente en moneda local |
| ● | 8,06% R.F.I. Crédito |
| ● | 6,96% R.F.I. High Yield |
| ● | 3,7% R.F.EURO Europa |
| ● | 3,24% R.V.I. Emergente Global |
| ● | 2,96% R.V.EURO Europa |
| ● | 2,2% R.F.I. Inflación |
| ● | 1,5% R.V.I. Japón |
| ● | 1,5% R.V.I. EE.UU. |
| ● | 1,12% R.V.I. GLOBAL Tecnología de la información |
| ● | 0,86% R.V.I. Emergente Asia |
| ● | 0,36% R.V.I. Servicios públicos |
| ● | 0,18% |



9. Operaciones realizadas durante el mes

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

| FECHA | FONDO | OPERACIÓN | %TIR OPERACIÓN | COTIZACIÓN | VALOR COMPRA | VALOR VENTA | GASTOS OPERACIÓN | PLUSVALÍAS / MINUSVALÍAS |
|------------|--|-----------|-------------------|------------|--------------|--------------|---------------------|-----------------------------|
| 04-09-2017 | PT. CANDRIAM EQUITIES L - EMERGING MARKETS- V ¿ | Compra | | 966,15 | 592.229,66 | | 0,00 | |
| 05-09-2017 | PT. CANDRIAM EQUITIES L - EMERGING MARKETS- I | Venta | | 956,45 | | 600.329,23 | 0,00 | 21.899,99 |
| 07-09-2017 | AC. VINCI (DG FP) | Venta | | 79,63 | | 277.637,76 | 277,92 | 25.290,40 |
| 12-09-2017 | PT. HENDERSON GARTMORE - UK ABSOLUTE RET-I¿ AH | Compra | | 7,17 | 167.080,00 | | 0,00 | |
| 12-09-2017 | PT. DNCA INVEST - MIURI - I ¿ (DMIURIE LX) | Compra | | 130,66 | 685.180,39 | | 0,00 | |
| 12-09-2017 | PT. TRAD FD-F&C RE EQ L/S-BEA (TFREEUB ID) | Venta | | 11,33 | | 225.097,35 | 0,00 | -1.242,16 |
| 13-09-2017 | PT. OLD MUT GB EQY ABS RE-IEURHA (OMEIEHA ID) | Compra | | 1,65 | 167.080,00 | | 0,00 | |
| 13-09-2017 | PT. BNY MELLON- ABSOLUTE RETURN EQUITY- ¿TH (BAREETH | Venta | | 1,18 | | 345.996,94 | 0,00 | 3.476,01 |
| 13-09-2017 | PT. EVLI SHORT CORP BOND-B (EVLEBFB FH) | Venta | | 29,07 | | 1.853.899,85 | 0,00 | 39.433,85 |
| 13-09-2017 | PT. EVLI SHORT CORPORATE BOND IB EUR (EVLEIBE FH) | Compra | | 101,60 | 1.852.688,10 | | 0,00 | |
| 14-09-2017 | PT. TRAD FD-F&C RE EQ L/S-BEA (TFREEUB ID) | Venta | | 11,32 | | 224.759,99 | 0,00 | -1.439,94 |
| 18-09-2017 | PT. TRAD FD-F&C RE EQ L/S-BEA (TFREEUB ID) | Venta | | 11,35 | | 225.038,95 | 0,00 | -843,10 |
| 22-09-2017 | PT. NOMURA ETF- TOPIX EX. TR.FUND (1306 JP) | Venta | | 12,64 | | 136.786,93 | 274,12 | 1.132,57 |
| 26-09-2017 | OB. ESTADO 4.10% VTO. 07/18 | Venta | -0,348 | 104,40 | | 1.211.086,08 | 0,00 | 0,00 |
| 26-09-2017 | PT. ODDO AVENIR EUROPA-B (ODEUMCB FP) | Compra | | 345.980,30 | 309.652,37 | | 0,00 | |
| 26-09-2017 | PT. PARVEST EQUITY JAPAN- SMALL CAP EUR (PEJSPHE LX) | Compra | | 179,96 | 137.124,12 | | 0,00 | |
| 28-09-2017 | AC. BANCO SANTANDER (SAN SM) | Venta | | 5,87 | | 49.527,08 | 32,17 | 7.922,44 |
| 28-09-2017 | AC. DANONE (BN FP) | Venta | | 65,67 | | 21.790,36 | 13,08 | 1.144,34 |
| 28-09-2017 | AC. ING GROEP (INGA NA) | Venta | | 15,54 | | 44.060,53 | 26,45 | 6.177,55 |
| 28-09-2017 | AC. E.ON (EOAN GR) | Venta | | 9,34 | | 28.370,71 | 17,03 | 6.352,99 |
| 28-09-2017 | AC. TOTAL (FP FP) | Venta | | 45,20 | | 25.433,06 | 15,27 | -1.602,78 |
| 28-09-2017 | AC. BASF SE (BAS GR) | Compra | | 89,07 | 13.546,88 | | 8,12 | |
| 28-09-2017 | AC. BNP-PARIBAS (BNP FP) | Venta | | 67,42 | | 30.592,26 | 18,37 | 6.046,52 |
| 28-09-2017 | AC. ALLIANZ (ALV GR) | Venta | | 186,55 | | 49.033,21 | 29,44 | 13.233,07 |

9. Operaciones realizadas durante el mes

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

| FECHA | FONDO | OPERACIÓN | %TIR OPERACIÓN | COTIZACIÓN | VALOR COMPRA | VALOR VENTA | GASTOS OPERACIÓN | PLUSVALÍAS / MINUSVALÍAS |
|--------------|--|-----------|-------------------|------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------------------|
| 28-09-2017 | AC. SIEMENS (SIE GR) | Compra | | 118,44 | 21.686,61 | | 13,00 | |
| 28-09-2017 | AC. BAYER AG (BAYN GR) | Venta | | 112,55 | | 32.957,36 | 19,79 | 4.207,37 |
| 28-09-2017 | AC. COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN (SGO FP) | Venta | | 49,82 | | 18.370,71 | 11,03 | 2.067,05 |
| 28-09-2017 | AC. PHILIPS (PHIA NA) | Venta | | 34,24 | | 271.864,84 | 163,22 | 83.780,72 |
| 28-09-2017 | AC. SAP (SAP GR) | Compra | | 91,94 | 643,97 | | 0,39 | |
| 28-09-2017 | AC. LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON (MC FP) | Compra | | 230,75 | 4.863,11 | | 17,45 | |
| 28-09-2017 | AC. LOREAL (OR FP) | Compra | | 177,52 | 283.267,18 | | 1.016,10 | |
| 28-09-2017 | AC. ENI (ENI IM) | Compra | | 13,94 | 11.964,94 | | 7,17 | |
| 28-09-2017 | AC. SANOFI (SAN FP) | Venta | | 84,18 | | 46.271,22 | 27,78 | 4.247,57 |
| 28-09-2017 | AC. DEUTSCHE TELEKOM (DTE GR) | Compra | | 15,68 | 8.977,03 | | 5,38 | |
| 28-09-2017 | AC. ORANGE (ORA FP) | Compra | | 13,81 | 2.522,49 | | 9,05 | |
| 28-09-2017 | AC. UNILEVER (UNA NA) | Venta | | 49,31 | | 378.348,16 | 227,15 | 72.608,50 |
| 28-09-2017 | AC. AXA (CS FP) | Venta | | 25,30 | | 5.284,53 | 3,17 | 247,35 |
| 28-09-2017 | AC. BMW (BMW GR) | Compra | | 84,16 | 18.358,41 | | 11,01 | |
| 28-09-2017 | AC. DAIMLER (DAI GR) | Compra | | 66,64 | 19.204,33 | | 11,52 | |
| 28-09-2017 | AC. ENEL (ENEL IM) | Venta | | 5,05 | | 31.043,91 | 18,64 | 5.764,37 |
| 28-09-2017 | AC. ASML HOLDING (ASML NA) | Compra | | 143,09 | 6.299,87 | | 3,78 | |
| 28-09-2017 | AC. ANHEUSER-BUSCH INBEV NV (ABI BB) | Compra | | 101,03 | 5.054,45 | | 3,03 | |
| 28-09-2017 | AC. INDITEX (ITX SM) | Compra | | 31,73 | 191.251,58 | | 99,42 | |
| 28-09-2017 | AC. VINCI (DG FP) | Venta | | 80,25 | | 17.805,28 | 10,69 | 1.753,39 |
| 28-09-2017 | AC. SCHNEIDER ELECTRIC (SU FP) | Compra | | 73,01 | 231.328,68 | | 829,80 | |
| 28-09-2017 | AC. ESSILOR INTERNACIONAL SA (EI FP) | Compra | | 103,37 | 152.916,94 | | 548,53 | |
| 28-09-2017 | AC. INTESA SANPAOLO (ISP IM) | Venta | | 2,99 | | 39.551,04 | 23,74 | 7.381,04 |
| TOTAL | | | | | 4.882.921,11 | 6.190.937,34 | 3.792,81 | 309.039,11 |

9. Operaciones realizadas durante el mes

Informe de Gestión a 30 de septiembre de 2017
PP de los Empleados de la Generalitat

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

Pensioval VII, F.P. (Generalitat)

de 2017

PP de los Empleados de la Generalitat

| COMPOSICIÓN DE LA CARTERA | | PATRIMONIO: 68.954.786,48 | | | | FECHA VALORACIÓN 30/09/2017 | | | | | 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. | % | | | |
| ES00000124V5 - BN. ESTADO 2.75% VTO. | 6.927 | 108,79 | T | 7.437.461,5 | 0,00 | 7.437.461,56 | 105,99 | 7.341.701,46 | 0,00 | 7.341.701,46 | 10,65 | -95.760,10 | -1,29 % | 30/04/2019 |
| ES00000127H7 - BN. ESTADO 1.15% VTO. | 2.590 | 104,26 | T | 2.676.376,5 | 0,00 | 2.676.376,50 | 103,74 | 2.681.919,10 | 5.059,37 | 2.686.978,47 | 3,90 % | 10.601,97 | 0,40 % | 30/07/2020 |
| IT0004992308 - BN. ESTADO ITALIANO 2.50% | 4.810 | 106,32 | T | 5.097.157,0 | 0,00 | 5.097.157,00 | 105,33 | 5.016.733,80 | 49.668,48 | 5.066.402,28 | 7,35 % | -30.754,72 | -0,60 % | 01/05/2019 |
| ES0378641171 - BN. FADE 3.375% VTO. 03/19 | 9 | 111,80 | T | 992.619,00 | 0,00 | 992.619,00 | 107,02 | 946.773,00 | 16.394,18 | 963.167,18 | 1,40 % | -29.451,82 | -2,97 % | 17/03/2019 |
| ES00000121A5 - OB. ESTADO 4.10% VTO. | 700 | 108,27 | T | 748.370,00 | 0,00 | 748.370,00 | 104,30 | 730.131,07 | 0,00 | 730.131,07 | 1,06 % | -18.238,93 | -2,44 % | 30/07/2018 |
| ES00000121O6 - OB. ESTADO 4.30% VTO. | 1.000 | 1,04 | T | 1.041.310,0 | 0,00 | 1.041.310,00 | 113,39 | 1.094.570,00 | 39.347,95 | 1.133.917,95 | 1,64 % | 92.607,95 | 8,89 % | 31/10/2019 |
| ES00000128B8 - OB. ESTADO 0.75% VTO. | 2.650 | 102,83 | T | 2.721.285,0 | 0,00 | 2.721.285,00 | 102,75 | 2.719.536,00 | 3.376,03 | 2.722.912,03 | 3,95 % | 1.627,03 | 0,06 % | 30/07/2021 |
| ES0000101396 - OB. COMUNIDAD MADRID | 400 | 0,99 | T | 396.584,00 | 0,00 | 396.584,00 | 113,94 | 445.376,00 | 10.377,82 | 455.753,82 | 0,66 % | 59.169,82 | 14,92 % | 12/03/2020 |
| IT0004489610 - OB. ESTADO ITALIANO 4.25% | 2.613 | 116,14 | T | 2.998.235,2 | 0,00 | 2.998.235,21 | 108,76 | 2.833.014,60 | 8.896,47 | 2.841.911,07 | 4,12 % | -156.324,14 | -5,21 % | 01/09/2019 |
| TOTAL EFECTOS PÚBLICOS | | | | | | 24.109.398,27 | | | | 23.942.875,33 | 34,72 % | -166.522,94 | -0,69 % | |
| ES03136793B0 - BN. BANKINTER 1.75% VTO. | 7 | 103,56 | T | 720.328,00 | 0,00 | 720.328,00 | 103,61 | 721.518,00 | 3.758,90 | 725.276,90 | 1,05 % | 4.948,90 | 0,69 % | 10/06/2019 |
| XS1264601805 - BN. SANTANDER CONSUMER | 14 | 101,61 | T | 1.420.266,3 | 0,00 | 1.420.266,31 | 101,24 | 1.414.812,00 | 2.615,89 | 1.417.427,89 | 2,06 % | -2.838,42 | -0,20 % | 30/07/2018 |
| ES0312298054 - CED. AYT CAJA GLOBAL 4% | 5 | 0,83 | T | 416.805,00 | 0,00 | 416.805,00 | 115,63 | 567.725,00 | 10.410,96 | 578.135,96 | 0,84 % | 161.330,96 | 38,71 % | 24/03/2021 |
| TOTAL FINANCIERO | | | | | | 2.557.399,31 | | | | 2.720.840,75 | 3,95 % | 163.441,44 | 6,39 % | |
| IT0004794142 - BN. ENEL 4.875% VTO. 02/18 | 590 | 116,44 | T | 667.909,50 | 0,00 | 667.909,50 | 104,91 | 601.463,70 | 17.493,90 | 618.957,60 | 0,90 % | -48.951,90 | -7,33 % | 20/02/2018 |
| TOTAL ELÉCTRICAS | | | | | | 667.909,50 | | | | 618.957,60 | 0,90 % | -48.951,90 | -7,33 % | |
| XS1372838083 - BN. VODAFONE GROUP VTO. | 1.300 | 101,33 | T | 1.313.494,0 | 0,00 | 1.313.494,00 | 101,26 | 1.315.509,00 | 807,30 | 1.316.316,30 | 1,91 % | 2.822,30 | 0,21 % | 25/02/2019 |
| XS0746276335 - BN. TELEFONICA EMISIONES | 1 | 1,01 | T | 101.149,00 | 0,00 | 101.149,00 | 104,82 | 101.912,00 | 2.904,48 | 104.816,48 | 0,15 % | 3.667,48 | 3,63 % | 21/02/2018 |
| XS0907289978 - OB. TELEFONICA EMISIONES | 4 | 1,00 | T | 401.024,00 | 0,00 | 401.024,00 | 115,12 | 452.300,00 | 8.160,75 | 460.460,75 | 0,67 % | 59.436,75 | 14,82 % | 26/03/2021 |
| TOTAL COMUNICACIÓN | | | | | | 1.815.667,00 | | | | 1.881.593,53 | 2,73 % | 65.926,53 | 3,63 % | |
| TOTAL RENTA FIJA | | | | | | 29.150.374,08 | | | | 29.164.267,21 | 42,29 % | 13.893,13 | 0,05 % | |
| ES0113900J37 - AC. BANCO SANTANDER | 57.083 | 4,92 | P | 281.055,35 | 0,00 | 281.055,35 | 5,91 | 337.189,28 | 0,00 | 337.189,28 | 0,49 % | 56.133,93 | 19,97 % | |

(*) 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. (Generalitat)

de 2017

PP de los Empleados de la Generalitat

| COMPOSICIÓN DE LA CARTERA | | PATRIMONIO: 68.954.786,48 | | | | | FECHA VALORACIÓN 30/09/2017 | | | | | | | |
|---|-------------|----------------------------|----------|-------------|-------------|---------------------|-----------------------------|--------------|-------|---------------------|---------------|-------------------|---------------|-------------|
| 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. | % | | | |
| NL0011821202 - AC. ING GROEP (INGA NA) | 18.125 | 13,35 | P | 242.026,42 | 0,00 | 242.026,42 | 15,60 | 282.750,00 | 0,00 | 282.750,00 | 0,41 % | 40.723,58 | 16,83 % | |
| FR0000131104 - AC. BNP-PARIBAS (BNP FP) | 5.071 | 54,07 | P | 274.166,14 | 0,00 | 274.166,14 | 68,25 | 346.095,75 | 0,00 | 346.095,75 | 0,50 % | 71.929,61 | 26,24 % | |
| DE0008404005 - AC. ALLIANZ (ALV GR) | 1.749 | 136,12 | P | 238.077,73 | 0,00 | 238.077,73 | 189,95 | 332.222,55 | 0,00 | 332.222,55 | 0,48 % | 94.144,82 | 39,54 % | |
| FR0000120628 - AC. AXA (CS FP) | 8.783 | 24,10 | P | 211.682,27 | 0,00 | 211.682,27 | 25,59 | 224.756,97 | 0,00 | 224.756,97 | 0,33 % | 13.074,70 | 6,18 % | |
| IT0000072618 - AC. INTESA SANPAOLO (ISP) | 71.172 | 2,43 | P | 172.761,10 | 0,00 | 172.761,10 | 2,99 | 212.946,62 | 0,00 | 212.946,62 | 0,31 % | 40.185,52 | 23,26 % | |
| IE00BJ7BPF87 - PT. LORD ABBETT | 87.660 | 11,78 | P | 1.032.612,1 | 0,00 | 1.032.612,11 | 12,18 | 1.067.703,14 | 0,00 | 1.067.703,14 | 1,55 % | 35.091,03 | 3,40 % | |
| FI4000233242 - PT. EVLI SHORT CORPORATE | 18.235 | 101,60 | P | 1.852.688,1 | 0,00 | 1.852.688,10 | 101,66 | 1.853.800,46 | 0,00 | 1.853.800,46 | 2,69 % | 1.112,36 | 0,06 % | |
| TOTAL FINANCIERO | | | | | | 4.305.069,22 | | | | 4.657.464,77 | 6,75 % | 352.395,55 | 8,19 % | |
| JP3027630007 - PT. NOMURA ETF- TOPIX EX. | 32.187 | 1.466,60 | P | 402.684,40 | 0,00 | 402.684,40 | 1.722,00 | 417.742,04 | 0,00 | 417.742,04 | 0,61 % | 15.057,64 | 3,74 % | |
| IE00BLP5S791 - PT. OLD MUT GB EQY ABS | 615.228 | 1,58 | P | 970.304,45 | 0,00 | 970.304,45 | 1,66 | 1.024.169,85 | 0,00 | 1.024.169,85 | 1,49 % | 53.865,40 | 5,55 % | |
| LU0034353002 - PT. DWS FLOATING RATES | 16.252 | 84,23 | P | 1.368.796,9 | 0,00 | 1.368.796,99 | 84,45 | 1.372.454,30 | 0,00 | 1.372.454,30 | 1,99 % | 3.657,31 | 0,27 % | |
| LU0255980244 - PT. PICTET - WATER - I USD | 407 | 365,42 | P | 136.056,25 | 0,00 | 136.056,25 | 386,69 | 133.290,03 | 0,00 | 133.290,03 | 0,19 % | -2.766,22 | -2,03 % | |
| DE0005933956 - PT. ISHARES EUROSTOXX 50 | 8.828 | 33,98 | P | 299.934,89 | 0,00 | 299.934,89 | 35,83 | 316.263,10 | 0,00 | 316.263,10 | 0,46 % | 16.328,21 | 5,44 % | |
| FR0007054358 - PT. LYXOR ETF DJ EURO | 4.079 | 35,82 | P | 146.113,45 | 0,00 | 146.113,45 | 35,01 | 142.805,79 | 0,00 | 142.805,79 | 0,21 % | -3.307,66 | -2,26 % | |
| LU0093503810 - PT. BLACKROCK GF- EURO | 43.220 | 15,97 | P | 690.219,25 | 0,00 | 690.219,25 | 15,99 | 691.083,64 | 0,00 | 691.083,64 | 1,00 % | 864,39 | 0,13 % | |
| LU1457522305 - PT. FIDELITY FUNDS- | 12.511 | 11,93 | P | 136.919,54 | 0,00 | 136.919,54 | 13,12 | 139.069,78 | 0,00 | 139.069,78 | 0,20 % | 2.150,24 | 1,57 % | |
| LU1601096537 - PT. AXA WORLD-FUNDS - | 6.857 | 99,91 | P | 685.119,94 | 0,00 | 685.119,94 | 100,23 | 687.314,30 | 0,00 | 687.314,30 | 1,00 % | 2.194,36 | 0,32 % | |
| IE0033758917 - PT. MUZINICH | 6.970 | 160,92 | P | 1.121.649,8 | 0,00 | 1.121.649,82 | 162,13 | 1.130.066,20 | 0,00 | 1.130.066,20 | 1,64 % | 8.416,38 | 0,75 % | |
| LU0145657366 - PT. DWS INVEST - EURO | 2.223 | 154,34 | P | 343.149,99 | 0,00 | 343.149,99 | 154,77 | 344.106,02 | 0,00 | 344.106,02 | 0,50 % | 956,03 | 0,28 % | |
| LU0490769915 - PT. HENDERSON GARTMORE | 140.128 | 6,68 | P | 935.426,36 | 0,00 | 935.426,36 | 7,20 | 1.008.252,15 | 0,00 | 1.008.252,15 | 1,46 % | 72.825,79 | 7,79 % | |
| LU0107852435 - PT. JB MULTIBOND- LOCAL | 5.293 | 315,62 | P | 1.523.902,6 | 0,00 | 1.523.902,65 | 334,03 | 1.497.950,93 | 0,00 | 1.497.950,93 | 2,17 % | -25.951,72 | -1,70 % | |
| FR0010251108 - PT. ODDO AVENIR EUROPA-B | 2 | 338.156,2 | P | 617.473,27 | 0,00 | 617.473,27 | 348.948,5 | 637.180,13 | 0,00 | 637.180,13 | 0,92 % | 19.706,86 | 3,19 % | |

(*) 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. (Generalitat)

de 2017

PP de los Empleados de la Generalitat

| COMPOSICIÓN DE LA CARTERA | | PATRIMONIO: 68.954.786,48 | | | | | FECHA VALORACIÓN 30/09/2017 | | | | | | |
|--|-------------|----------------------------|----------|-------------|-------------|----------------------|-----------------------------|--------------|-------|----------------------|----------------|-------------------|---------------|
| 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. | % | | |
| FR0010760694 - PT. CANDRIAM LONG SHORT | 344 | 1.156,69 | P | 397.526,59 | 0,00 | 397.526,59 | 1.166,72 | 400.973,66 | 0,00 | 400.973,66 | 0,58 % | 3.447,07 | 0,87 % |
| LU0151325312 - PT. CANDRIAM BONDS - | 1.928 | 216,82 | P | 418.113,91 | 0,00 | 418.113,91 | 225,41 | 434.676,36 | 0,00 | 434.676,36 | 0,63 % | 16.562,45 | 3,96 % |
| FR0010830844 - PT. AMUNDI - AMUNDI 12M- I | 11 | 106.848,8 | P | 1.163.798,1 | 0,00 | 1.163.798,12 | 107.317,3 | 1.168.900,69 | 0,00 | 1.168.900,69 | 1,70 % | 5.102,57 | 0,44 % |
| IE00B3YCGJ38 - PT. SOURCE S&P 500 UCITS | 1.485 | 358,92 | P | 499.338,25 | 0,00 | 499.338,25 | 440,86 | 554.663,80 | 0,00 | 554.663,80 | 0,80 % | 55.325,55 | 11,08 % |
| IE00BN8SY486 - PT. BLACKSTONE | 65.782 | 10,43 | P | 686.106,00 | 0,00 | 686.106,00 | 10,55 | 693.999,84 | 0,00 | 693.999,84 | 1,01 % | 7.893,84 | 1,15 % |
| LU0641746143 - PT. DNCA INVEST - MIURI - I | 5.244 | 130,66 | P | 685.180,39 | 0,00 | 685.180,39 | 131,32 | 688.641,42 | 0,00 | 688.641,42 | 1,00 % | 3.461,03 | 0,51 % |
| LU0192064839 - PT. UBAM-CORPORATE USD | 7.572 | 146,03 | P | 1.105.690,7 | 0,00 | 1.105.690,75 | 146,49 | 1.109.198,99 | 0,00 | 1.109.198,99 | 1,61 % | 3.508,24 | 0,32 % |
| IE0032883534 - PT. PIMCO US - HIGH YIELD | 38.045 | 26,60 | P | 1.011.936,9 | 0,00 | 1.011.936,99 | 28,15 | 1.070.960,22 | 0,00 | 1.070.960,22 | 1,55 % | 59.023,23 | 5,83 % |
| IE00BHZKQB61 - PT.PIMCO FGIS-GLOBAL | 82.018 | 9,97 | P | 817.524,99 | 0,00 | 817.524,99 | 9,97 | 817.718,51 | 0,00 | 817.718,51 | 1,19 % | 193,52 | 0,02 % |
| LU1212701376 - PT. FRANKLIN TEMPL IF - FT | 27.783 | 10,52 | P | 292.239,99 | 0,00 | 292.239,99 | 11,44 | 317.835,72 | 0,00 | 317.835,72 | 0,46 % | 25.595,73 | 8,76 % |
| LU1279333329 - PT. PICTET - ROBOTICS - I | 1.120 | 132,76 | P | 136.744,50 | 0,00 | 136.744,50 | 149,26 | 141.612,99 | 0,00 | 141.612,99 | 0,21 % | 4.868,49 | 3,56 % |
| ES0107575005 - PT. ALTAMAR IX GLOBAL | 59.500 | 1,01 | P | 60.043,66 | 0,00 | 60.043,66 | 1,07 | 63.367,50 | 0,00 | 63.367,50 | 0,09 % | 3.323,84 | 5,54 % |
| LU0256845834 - PT. PICTET - SECURITY - I | 667 | 222,85 | P | 136.380,74 | 0,00 | 136.380,74 | 241,00 | 136.217,02 | 0,00 | 136.217,02 | 0,20 % | -163,72 | -0,12 % |
| LU0602539354 - PT. NORDEA 1- EMERGING | 5.235 | 124,87 | P | 578.719,21 | 0,00 | 578.719,21 | 137,09 | 608.068,66 | 0,00 | 608.068,66 | 0,88 % | 29.349,45 | 5,07 % |
| LU0520955575 - PT. BLACKROCK GF- | 80.394 | 25,49 | P | 1.816.410,5 | 0,00 | 1.816.410,50 | 26,55 | 1.808.411,76 | 0,00 | 1.808.411,76 | 2,62 % | -7.998,74 | -0,44 % |
| LU0925122235 - PT. PARVEST EQUITY JAPAN- | 762 | 179,96 | P | 137.124,12 | 0,00 | 137.124,12 | 184,82 | 140.827,30 | 0,00 | 140.827,30 | 0,20 % | 3.703,18 | 2,70 % |
| LU1376389679 - PT. GENERALI INV SICAV- | 13.437 | 100,00 | P | 1.343.686,3 | 0,00 | 1.343.686,30 | 100,12 | 1.345.298,72 | 0,00 | 1.345.298,72 | 1,95 % | 1.612,42 | 0,12 % |
| LU0607519435 - PT. INVESCO EURO SHORT | 29.937 | 11,46 | P | 343.149,98 | 0,00 | 343.149,98 | 11,49 | 344.069,05 | 0,00 | 344.069,05 | 0,50 % | 919,07 | 0,27 % |
| LU1599083646 - PT. DEUTSCHE INV I SHORT | 3.415 | 100,49 | P | 343.149,94 | 0,00 | 343.149,94 | 100,72 | 343.935,33 | 0,00 | 343.935,33 | 0,50 % | 785,39 | 0,23 % |
| LU0317020112 - PT. CANDRIAM EQUITIES L - | 613 | 966,15 | P | 592.229,66 | 0,00 | 592.229,66 | 966,25 | 592.290,96 | 0,00 | 592.290,96 | 0,86 % | 61,30 | 0,01 % |
| TOTAL INVERSIÓN | | | | | | 21.942.845,84 | | | | 22.323.416,76 | 32,37 % | 380.570,92 | 1,73 % |
| FR0000125486 - AC. VINCI (DG FP) | 2.264 | 72,31 | P | 163.700,41 | 0,00 | 163.700,41 | 80,40 | 182.025,60 | 0,00 | 182.025,60 | 0,26 % | 18.325,19 | 11,19 % |

(*) 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. (Generalitat)

de 2017

PP de los Empleados de la Generalitat

| COMPOSICIÓN DE LA CARTERA | | PATRIMONIO: 68.954.786,48 | | | | | FECHA VALORACIÓN 30/09/2017 | | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------|----------------------------|----------|------------|-------------|---------------------|-----------------------------|------------|-------|---------------------|---------------|-------------------|----------------|--|
| 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. | % | | | |
| ES0118900010 - AC. FERROVIAL (FER SM) | 18.533 | 18,83 | P | 349.014,12 | 0,00 | 349.014,12 | 18,63 | 345.177,13 | 0,00 | 345.177,13 | 0,50 % | -3.836,99 | -1,10 % | |
| TOTAL CONSTRUCCIÓN | | | | | | 512.714,53 | | | | 527.202,73 | 0,76 % | 14.488,20 | 2,83 % | |
| DE000ENAG999 - AC. E.ON (EOAN GR) | 20.252 | 7,24 | P | 146.630,34 | 0,00 | 146.630,34 | 9,58 | 193.933,15 | 0,00 | 193.933,15 | 0,28 % | 47.302,81 | 32,26 % | |
| IT0003128367 - AC. ENEL (ENEL IM) | 37.114 | 4,11 | P | 152.532,10 | 0,00 | 152.532,10 | 5,10 | 189.095,83 | 0,00 | 189.095,83 | 0,27 % | 36.563,73 | 23,97 % | |
| TOTAL ELÉCTRICAS | | | | | | 299.162,44 | | | | 383.028,98 | 0,56 % | 83.866,54 | 28,03 % | |
| FR0000120644 - AC. DANONE (BN FP) | 2.423 | 62,19 | P | 150.678,67 | 0,00 | 150.678,67 | 66,37 | 160.814,51 | 0,00 | 160.814,51 | 0,23 % | 10.135,84 | 6,73 % | |
| NL0011794037 - AC. AHOLD (AD NA) | 8.446 | 19,83 | P | 167.455,43 | 0,00 | 167.455,43 | 15,82 | 133.615,72 | 0,00 | 133.615,72 | 0,19 % | -33.839,71 | -20,21 % | |
| FR0000120321 - AC. LOREAL (OR FP) | 1.590 | 178,16 | P | 283.267,18 | 0,00 | 283.267,18 | 179,90 | 286.041,00 | 0,00 | 286.041,00 | 0,41 % | 2.773,82 | 0,98 % | |
| BE0974293251 - AC. ANHEUSER-BUSCH | 2.356 | 98,93 | P | 233.067,28 | 0,00 | 233.067,28 | 101,30 | 238.662,80 | 0,00 | 238.662,80 | 0,35 % | 5.595,52 | 2,40 % | |
| TOTAL ALIMENTACIÓN | | | | | | 834.468,56 | | | | 819.134,03 | 1,19 % | -15.334,53 | -1,84 % | |
| DE0007236101 - AC. SIEMENS (SIE GR) | 3.862 | 116,53 | P | 450.051,10 | 0,00 | 450.051,10 | 119,20 | 460.350,40 | 0,00 | 460.350,40 | 0,67 % | 10.299,30 | 2,29 % | |
| FR0000125007 - AC. COMPAGNIE DE SAINT | 3.379 | 44,18 | P | 149.295,62 | 0,00 | 149.295,62 | 50,42 | 170.369,18 | 0,00 | 170.369,18 | 0,25 % | 21.073,56 | 14,12 % | |
| DE0005190003 - AC. BMW (BMW GR) | 1.789 | 89,09 | P | 159.379,21 | 0,00 | 159.379,21 | 85,83 | 153.549,87 | 0,00 | 153.549,87 | 0,22 % | -5.829,34 | -3,66 % | |
| DE0007100000 - AC. DAIMLER (DAI GR) | 3.977 | 67,14 | P | 267.018,34 | 0,00 | 267.018,34 | 67,47 | 268.328,19 | 0,00 | 268.328,19 | 0,39 % | 1.309,85 | 0,49 % | |
| FR0000121972 - AC. SCHNEIDER ELECTRIC | 3.157 | 73,28 | P | 231.328,68 | 0,00 | 231.328,68 | 73,63 | 232.449,91 | 0,00 | 232.449,91 | 0,34 % | 1.121,23 | 0,48 % | |
| TOTAL INDUSTRIAL | | | | | | 1.257.072,95 | | | | 1.285.047,55 | 1,86 % | 27.974,60 | 2,23 % | |
| FR0000120271 - AC. TOTAL (FP FP) | 7.909 | 48,02 | P | 379.798,27 | 0,00 | 379.798,27 | 45,45 | 359.424,51 | 0,00 | 359.424,51 | 0,52 % | -20.373,76 | -5,36 % | |
| IT0003132476 - AC. ENI (ENI IM) | 13.631 | 16,74 | P | 228.208,92 | 0,00 | 228.208,92 | 14,00 | 190.834,00 | 0,00 | 190.834,00 | 0,28 % | -37.374,92 | -16,38 % | |
| TOTAL PETRÓLEO | | | | | | 608.007,19 | | | | 550.258,51 | 0,80 % | -57.748,68 | -9,50 % | |
| DE000BASF111 - AC. BASF SE (BAS GR) | 3.856 | 86,27 | P | 332.662,77 | 0,00 | 332.662,77 | 90,04 | 347.194,24 | 0,00 | 347.194,24 | 0,50 % | 14.531,47 | 4,37 % | |
| DE000BAY0017 - AC. BAYER AG (BAYN GR) | 3.125 | 98,12 | P | 306.633,87 | 0,00 | 306.633,87 | 115,30 | 360.312,50 | 0,00 | 360.312,50 | 0,52 % | 53.678,63 | 17,51 % | |
| FR0000120578 - AC. SANOFI (SAN FP) | 5.388 | 76,41 | P | 411.678,97 | 0,00 | 411.678,97 | 84,01 | 452.645,88 | 0,00 | 452.645,88 | 0,66 % | 40.966,91 | 9,95 % | |

(*) 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. (Generalitat)

de 2017

PP de los Empleados de la Generalitat

| COMPOSICIÓN DE LA CARTERA | | PATRIMONIO: 68.954.786,48 | | | | | FECHA VALORACIÓN 30/09/2017 | | | | | | | |
|--|-------------|----------------------------|----------|------------|-------------|----------------------|-----------------------------|------------|-------|----------------------|----------------|---------------------|----------------|-------------|
| 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. | % | | | |
| FR0000121667 - AC. ESSILOR | 1.474 | 103,74 | P | 152.916,94 | 0,00 | 152.916,94 | 104,75 | 154.401,50 | 0,00 | 154.401,50 | 0,22 % | 1.484,56 | 0,97 % | |
| TOTAL QUIMICO | | | | | | 1.203.892,55 | | | | 1.314.554,12 | 1,91 % | 110.661,57 | 9,19 % | |
| ES0178430E18 - AC. TELEFONICA (TEF SM) | 33.476 | 10,40 | P | 348.020,37 | 0,00 | 348.020,37 | 9,19 | 307.711,39 | 0,00 | 307.711,39 | 0,45 % | -40.308,98 | -11,58 % | |
| DE0005557508 - AC. DEUTSCHE TELEKOM | 15.963 | 16,11 | P | 257.215,38 | 0,00 | 257.215,38 | 15,79 | 251.975,96 | 0,00 | 251.975,96 | 0,37 % | -5.239,42 | -2,04 % | |
| FR0000133308 - AC. ORANGE (ORA FP) | 10.934 | 14,42 | P | 157.700,28 | 0,00 | 157.700,28 | 13,86 | 151.545,24 | 0,00 | 151.545,24 | 0,22 % | -6.155,04 | -3,90 % | |
| IT0003497168 - AC. TELECOM ITALIA (TIT IM) | 272.161 | 0,83 | P | 224.698,37 | 0,00 | 224.698,37 | 0,79 | 215.687,59 | 0,00 | 215.687,59 | 0,31 % | -9.010,78 | -4,01 % | |
| TOTAL COMUNICACIÓN | | | | | | 987.634,40 | | | | 926.920,18 | 1,34 % | -60.714,22 | -6,15 % | |
| GB0007188757 - AC. RIO TINTO (RIO LN) | 7.562 | 37,79 | P | 310.240,60 | 0,00 | 310.240,60 | 34,73 | 298.034,79 | 0,00 | 298.034,79 | 0,43 % | -12.205,81 | -3,93 % | |
| TOTAL MATERIAS PRIMAS | | | | | | 310.240,60 | | | | 298.034,79 | 0,43 % | -12.205,81 | -3,93 % | |
| FR0000121014 - AC. LVMH MOET HENNESSY | 1.414 | 183,57 | P | 259.566,54 | 0,00 | 259.566,54 | 233,45 | 330.098,30 | 0,00 | 330.098,30 | 0,48 % | 70.531,76 | 27,17 % | |
| ES0148396007 - AC. INDITEX (ITX SM) | 6.025 | 31,74 | P | 191.251,58 | 0,00 | 191.251,58 | 31,89 | 192.107,13 | 0,00 | 192.107,13 | 0,28 % | 855,55 | 0,45 % | |
| TOTAL DISTRIBUCION | | | | | | 450.818,12 | | | | 522.205,43 | 0,76 % | 71.387,31 | 15,84 % | |
| ES0105223004 - AC. GESTAMP AUTOMOCION | 48.783 | 5,65 | P | 275.357,02 | 0,00 | 275.357,02 | 5,36 | 261.379,31 | 0,00 | 261.379,31 | 0,38 % | -13.977,71 | -5,08 % | |
| TOTAL OTRAS INDUSTRIAS Y SERVICIOS | | | | | | 275.357,02 | | | | 261.379,31 | 0,38 % | -13.977,71 | -5,08 % | |
| DE0007164600 - AC. SAP (SAP GR) | 4.142 | 83,47 | P | 345.719,20 | 0,00 | 345.719,20 | 92,69 | 383.921,98 | 0,00 | 383.921,98 | 0,56 % | 38.202,78 | 11,05 % | |
| FI0009000681 - AC. NOKIA (NOKIA FH) | 39.312 | 4,35 | P | 171.087,12 | 0,00 | 171.087,12 | 5,08 | 199.704,96 | 0,00 | 199.704,96 | 0,29 % | 28.617,84 | 16,73 % | |
| NL0010273215 - AC. ASML HOLDING (ASML) | 1.615 | 108,20 | P | 174.748,99 | 0,00 | 174.748,99 | 144,05 | 232.640,75 | 0,00 | 232.640,75 | 0,34 % | 57.891,76 | 33,13 % | |
| TOTAL TECNOLOGIA | | | | | | 691.555,31 | | | | 816.267,69 | 1,18 % | 124.712,38 | 18,03 % | |
| TOTAL RENTA VARIABLE | | | | | | 33.678.838,73 | | | | 34.684.914,85 | 50,30 % | 1.006.076,12 | 2,99 % | |
| TOTAL CARTERA DE VALORES | | | | | | 62.829.212,81 | | | | 63.849.182,06 | 92,60 % | 1.019.969,25 | 1,62 % | |

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

Importe en Euros

Bankia
pensiones >