



Estado de valoración de Cartera de Gestión por Sectores

Fecha: 31/12/2017

MARCH PENSIONES PROTECCION, F.P. (21726)

EUR

dw\_uo\_lis\_hisval\_gestion\_sector

Instrumento	Títulos	Cº Medio Coste	Coste Cup.	Cotización	Efectivo	Cambio Divisa /Den.	Plusvalía / Minusvalía	% s/ C. Adq.	% s/ RV	% s/P	Cupón Adq.Compra	Intereses Periodificados
-------------	---------	----------------	------------	------------	----------	---------------------	------------------------	--------------	---------	-------	------------------	--------------------------

Depósitos

- Eurodepositos y Ctas/Ctes

Tesorería

2220- CC EUR B. MARCH	19.012,22	1,0000	19.012,22		19.012,22	1,0000				0,20		
Deudores/Acreedores					-17.229,92							
<b>Total Tesorería:</b>			19.012,22		1.782,30					0,20		
<b>Total Depósitos - Eurodepositos y Ctas/Ctes:</b>			19.012,22		1.782,30					0,20		

Otros Valores

- Opciones Compradas CALL

Derivatives

OPC. AUTOCALL 7Y SX5E 05/11/2019	5.250.000,	17,6500	926.625,00	44,1900	2.319.975,00	1,0000	1.393.350,00	150,37		24,69		
<b>Total Derivatives:</b>			926.625,00		2.319.975,00		1.393.350,00	150,37		24,69		
<b>Total Otros Valores - Opciones Compradas CALL:</b>			926.625,00		2.319.975,00		1.393.350,00	150,37		24,69		

Renta Fija

- Contado

Government

B. ESTADO 4,3% 31/10/19	1.700,	93,8142	1.594.840,83	104,1050	1.857.120,99	1,0000	174.944,62	16,45		18,84		87.335,54
B. ESTADO 4,6% 30/07/2019	500,	97,2000	486.000,00	105,7726	548.957,12	1,0000	42.863,17	12,95		5,63		20.093,95
B. ESTADO 4,85% 31/10/2020	85.000,	114,6294	97.434,99	114,6294	97.431,78	1,0000		-0,00		1,04		-3,21
ICO 4,375% 20/05/2019	500,	92,9167	464.583,33	101,0966	546.094,52	1,0000	40.899,70	17,55		5,38		40.611,49
STRIP BE CC PPAL 4,3% 31/10/2019	40,	69,9600	2.798.400,00	79,0938	4.024.200,00	1,0000	365.351,37	43,80		33,67		860.448,63
<b>Total Government:</b>			5.441.259,15		7.073.804,41		624.058,86	30,00		64,56		1.008.486,40
<b>Total Renta Fija - Contado:</b>			5.441.259,15		7.073.804,41		624.058,86	11,47		64,56		1.008.486,40

Liquidez Total: 1.782,30

Patrimonio Total: 9.395.561,71

Valor Liquidativo: 14,798940