



Estado de valoración de Cartera de Gestión por Sectores

Fecha: 30/09/2017

Página 1 de 2

Fecha: 15/12/2017

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	19.306,29	1,0000	19.306,29		19.306,29	1,0000				0,20		
Deudores/Acreedores					-26.104,67							
Total Tesorería:			19.306,29		-6.798,38					0,20		
Total Depósitos - Eurodepositos y Ctas/Ctes:			19.306,29		-6.798,38					0,20		

- Imposiciones Plazo Fijo

Financiaci

IPF SABADELL 0,06% 28/02/2018	120.000,00	100,0000	120.000,00	100,0015	120.044,84	1,0000	1,84	0,04		1,22		43,00
Total Financiaci:			120.000,00		120.044,84		1,84	0,04		1,22		43,00
Total Depósitos - Imposiciones Plazo Fijo:			120.000,00		120.044,84		1,84			1,22		43,00

Otros Valores

- Opciones Compradas CALL

Derivatives

OPC. AUTOCALL 7Y SX5E 05/11/2019	5.250.000,00	17,6500	926.625,00	49,1900	2.582.475,00	1,0000	1.655.850,00	178,70		26,31		
Total Derivatives:			926.625,00		2.582.475,00		1.655.850,00	178,70		26,31		
Total Otros Valores - Opciones Compradas CALL:			926.625,00		2.582.475,00		1.655.850,00	178,70		26,31		

Renta Fija

- Contado

Government

B. ESTADO 4,3% 31/10/19	1.700,00	93,8142	1.594.840,83	105,3258	1.928.761,78	1,0000	195.697,83	20,94		18,24		138.223,12
B. ESTADO 4,3% 31/10/19	68.000,00	113,1513	76.942,87	113,1513	76.941,19	1,0000		-0,00		0,78		-1,68
B. ESTADO 4,6% 30/07/2019	500,00	97,2000	486.000,00	107,0291	548.959,86	1,0000	49.145,39	12,95		5,45		13.814,47
ICO 4,375% 20/05/2019	500,00	92,9167	464.583,33	102,4505	545.920,82	1,0000	47.669,20	17,51		5,22		33.668,29



Estado de valoración de Cartera de Gestión por Sectores

Fecha: 30/09/2017

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
-------------	---------	----------------	------------	------------	----------	---------------------	------------------------	--------------	---------	-------	------------------	--------------------------

Renta Fija

- Contado

Government

STRIP BE CC PPAL 4,3% 31/10/2019	40,	69,9600	2.798.400,00	80,1152	4.020.320,00	1,0000	406.206,33	43,66		32,64		815.713,67
Total Government:			5.420.767,03		7.120.903,65		698.718,75	31,36		62,34		1.001.417,87
Total Renta Fija - Contado:			5.420.767,03		7.120.903,65		698.718,75	12,89		62,34		1.001.417,87

Liquidez Total:	-6.798,38
------------------------	------------------

Patrimonio Total:	9.816.625,11
Valor Liquidativo:	15,246510