



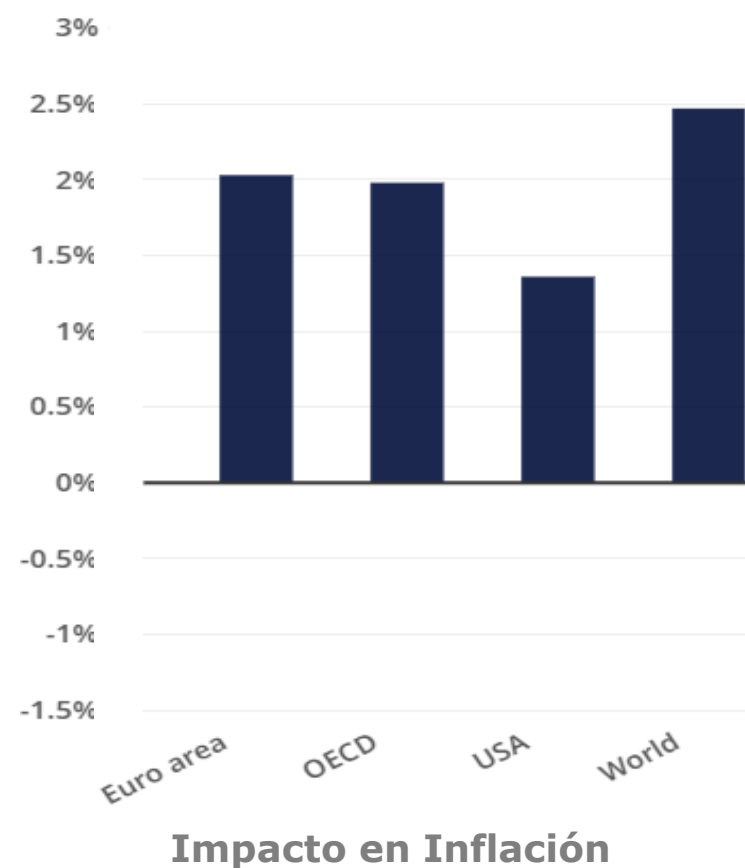
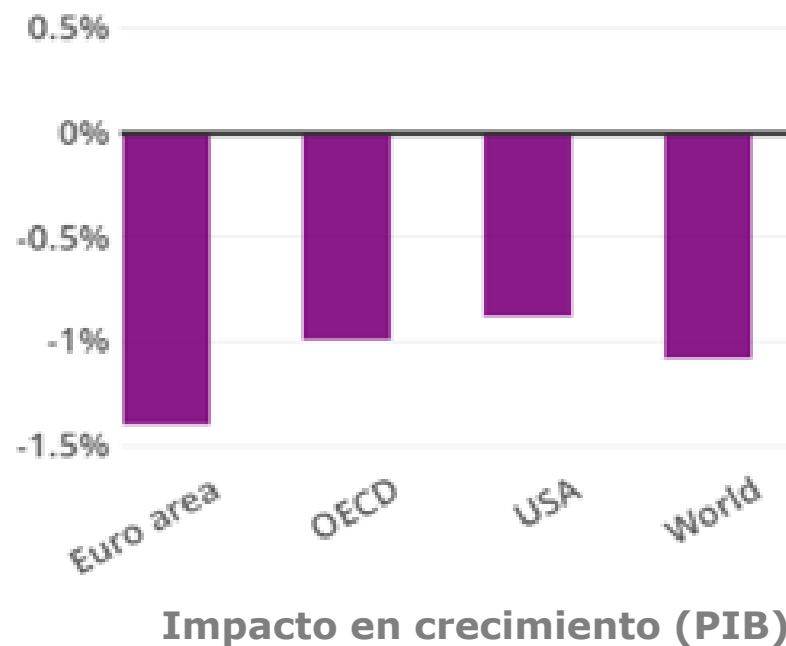
Comisión de Control

EMPLEADOS CCAA CANARIAS, F.P.



Comunidad
Autónoma
de Canarias

Entorno Macro y Mercados Financieros	Págs. 3-5
Ficha del fondo a 31 Diciembre 2021	Pág. 6
Rentabilidad vs INVERCO Planes Empleo a 31-12-21	Pág. 7
Atribución de resultados a 31-12-21	Pág. 8
Evolución Histórica Fondo	Pág. 9
Ficha del Fondo a 31-03-22	Pág. 10
Rentabilidad vs INVERCO Planes Individuales a 28-02-22	Pág. 11
Atribución de resultados a 31-03-22	Pág. 12
Segmentación de la Cartera	Pág. 13
Detalle de Cartera Actual	Págs. 14-16



Fuente: OCDE

- **Antes** de la invasión de Ucrania por parte de Rusia, la reapertura económica post-ómico permitía dar continuidad a la inercia positiva de la demanda agregada global como principal característica en el mundo desarrollado, gracias a la política fiscal expansiva de los Fondos anti pandemia, los estímulos monetarios y las condiciones financieras ventajosas, el incremento de los precios inmobiliarios, el ahorro y la riqueza financiera de las familias, etc. Por su parte, la inversión pública en infraestructuras y un modelo energético más sostenible (renovables) también contribuía a dar soporte a nuestra estimación estratégica.
- Con el estallido del conflicto asistimos a un **deterioro de las perspectivas de crecimiento económico**, principalmente debido a sus efectos en el componente energético. Es previsible que se inicie un periodo de **estanflación**, con tasas de inflación elevadas y crecimiento estancado o reducido, debido al impacto de la crisis en la actividad económica y los efectos de las sanciones. En caso de que el conflicto no sea prolongado la moderación del crecimiento sería menor, sin hacer descarrilar la recuperación global iniciada meses atrás. Por el contrario, una extensión del mismo cambiaría drásticamente la visión de la evolución futura de las economías.
- El mayor impacto, por tanto, se centra en la dependencia energética europea y la **presión inflacionista** que los **precios de las materias primas** (*gas y petróleo*) están teniendo en el resto de sectores económicos (transporte, industrial, turismo, etc.).
- Como segundo efecto del conflicto, podríamos asistir a la **pérdida de confianza de los consumidores**, que frenaría la demanda y podría hacer crecer los temores a una futura desaceleración.
- **Conclusión:** Esperamos un crecimiento macroeconómico **sólido en USA**, junto con tasas de inflación altas y una política monetaria más estricta. En **Eurozona, una recesión es poco probable**, aunque el gasto de consumo podría disminuir dado el impacto de la inflación en el crecimiento a corto plazo de ingresos reales.

TIPOS A CORTO PZO. Y POLITICA MONETARIA

Los bancos centrales retiran medidas de estímulo y comienzan el proceso de normalización de políticas monetarias.

- El **BCE**, en su reunión de Marzo, confirmó la finalización del programa PEPP en Marzo, y anunció que reduciría gradualmente las compras de activos del APP desde los 40MM€ de Abril, a 30MM€ en Mayo y 20MM€ en Junio, dejando la puerta abierta a prolongarlo dependiendo de datos macro.
- En sus previsiones macro mostró una revisión al alza en los precios y a la baja en crecimiento. (Ver tabla inferior)
- La **Reserva Federal** subió los tipos 25pb en marzo. Se espera que continúe subiendo durante el 2022

Proyecciones macro del BCE (Marzo)

(escenario base)	2022	2023	2024
PIB Real	3,7	2,8	1,6
Proyección Diciembre	4,2	2,9	1,6
IPC general	5,1	2,1	1,9
Proyección Diciembre	3,2	1,8	1,8
IPC subyacente	2,6	1,8	1,9
Proyección Diciembre	1,9	1,7	1,8

	Escenario adverso			Escenario severo		
	2022	2023	2024	2022	2023	2024
PIB Real	2,5	2,7	2,1	2,3	2,3	1,9
IPC general	5,9	2,0	1,6	7,1	2,7	1,9

Fuente: BCE

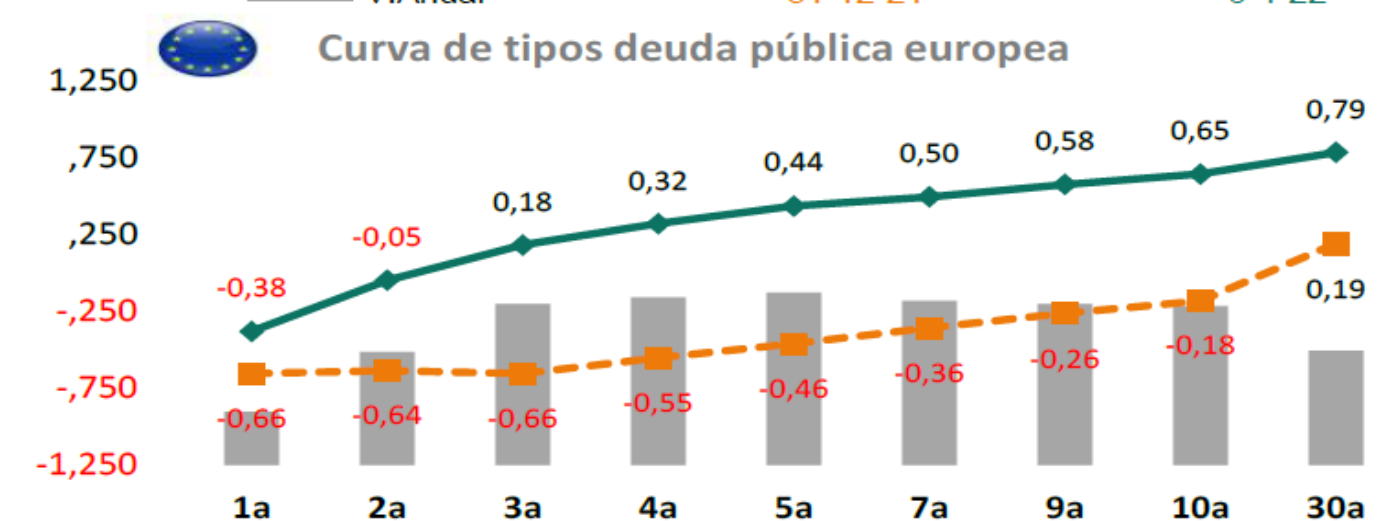
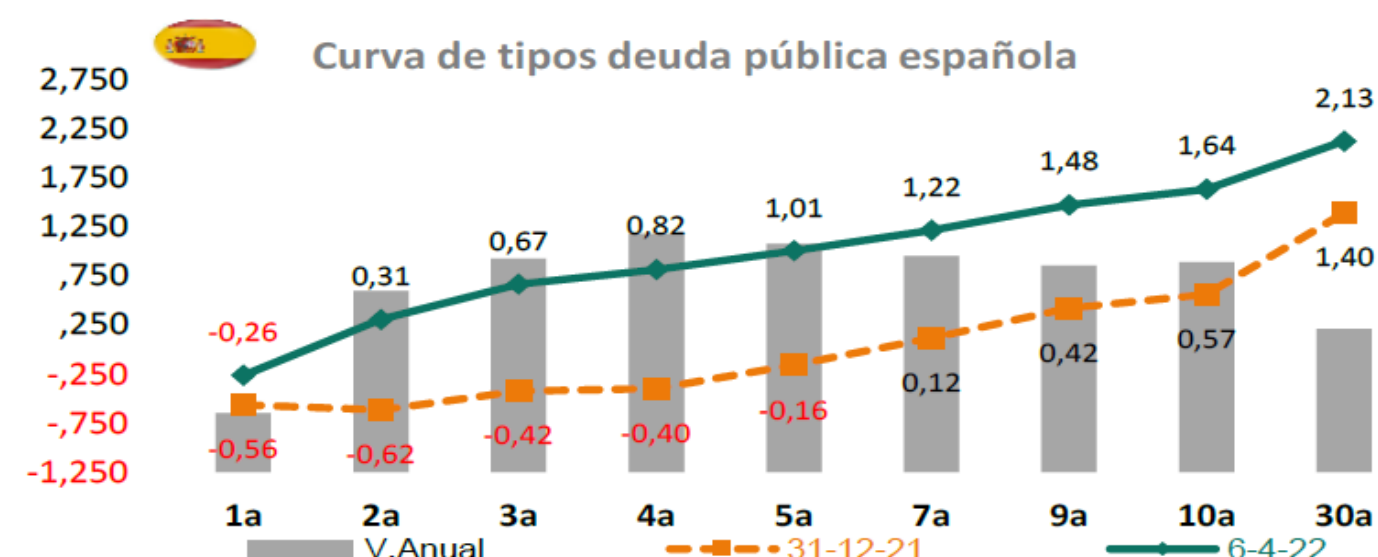
Escenario adverso: Asume sanciones severas a Rusia que llevan a interrupciones en la cadena de suministro. Se plantean cortes en el suministro de gas a Rusia lo que lleva a incrementos mayores del coste de la energía y por ello recortes en la producción de la Zona Euro. Se trata de algo temporal ya que se produce la sustitución del gas por otras fuentes de energía.

Escenario Severo: Se trata de un escenario con mayores interrupciones en la cadena de suministro y por ello mayores cortes en la producción que llevan al PIB a caer 1,4 pp por debajo del escenario base en 2022 con la inflación aumentando en 2,0 pp por encima de dicha referencia.

TIPOS A LARGO PLAZO

Fuerte repunte de tipos en todos los plazos y en todas las curvas: deuda española, europea, swap, etc.

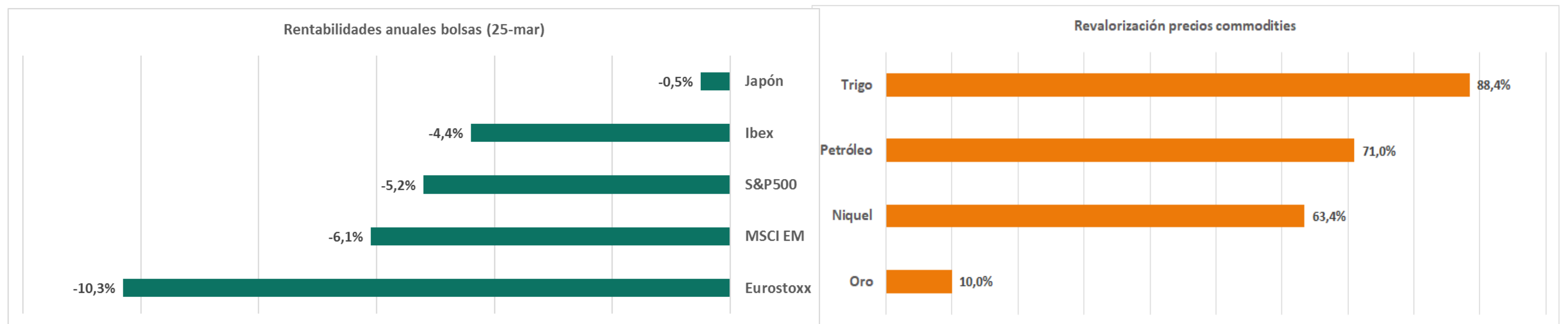
- El tipo alemán a 10 años ha pasado del -0,18% al 0,50%. El americano, se ha elevado desde el 1,51% hasta el 2,50%.
- Las **primas de riesgo periféricas** han aumentado. España a 87pb, desde 70, e Italia a 152pb desde 125.
- RF Privada:** Aumento generalizado de diferenciales de crédito, en todos los sectores, debido a la mayor incertidumbre sobre futuros beneficios, por el incremento de costes, así como a la retirada de los programas de estímulo de los bancos centrales.



RENTA VARIABLE



- A comienzos de año, la inflación (7,5% en enero en USA) y los mensajes de la Fed y el BCE apuntando a **políticas monetarias más restrictivas** provocaron subida de tipos y mayores tasas de descuento para beneficios esperados que lastraron las bolsas.
- Los valores más ligados a tecnología y empresas de crecimiento (que no generan beneficios hoy pero que los generarán en el largo plazo) son los que más sufrieron las subidas de tipos (NASDAQ cayó un -9% en enero vs. -3% en Europa).
- Los beneficios empresariales fueron buenos en 2021, cumpliendo expectativas. El 60% de las empresas del S&P500 batieron, siendo los bancos, tecnología y consumo del lujo los que registraron mayores crecimientos.
- Posteriormente, las **tensiones en Ucrania** atrajeron el foco de los mercados, haciendo caer bruscamente los índices en la primera semana de marzo (-9,4% en Europa), el barril del petróleo se fue por encima de 100\$, el EUR se depreció frente al USD y los tipos cayeron en toda la curva.
- Europa tomó medidas urgentes: cierre de mercados para Rusia, paquetes de emergencia fiscales (Italia 8 bn en medidas, Alemania incrementando el gasto en defensa), flexibilización de límites de deuda, búsqueda de fuentes alternativas de suministro del gas, etc. A día de hoy, Europa y USA siguen trabajando en más medidas.
- El **impacto de Rusia** en las compañías europeas es **limitado**: se estima que sólo el 2% de las ventas tenían su destino en Rusia y sólo el 3,5% de las mismas en Europa del Este. Utilities y Energía son los más afectados (ej. con los acuerdos con empresas rusas como Gazprom)
- Las exportaciones europeas a Rusia son del 0,7% del PIB y la exposición de los bancos a Rusia del 0,2% del balance agregado.
- Las bolsas han rebotado desde mínimos de marzo gracias a la acción rápida y coordinada de los países de occidente.
- Los mercados de valores pueden beneficiarse aún de un crecimiento económico sólido a 12 meses, pero con una **volatilidad más alta** sin descartar posibles recaídas en los próximos meses.



Fuente: OCED (precios medios desde febrero 22 a 14 marzo 22)

FICHA DEL FONDO a 31-12-21



INFORMACIÓN DEL FONDO

Fecha de Constitución	07/11/2005
Entidad Depositaria	CECABANK, S.A.
Valor Liquidativo	9,624274
Patrimonio	26.043.765,33
Composición Benchmark	70% Renta Fija, 20% Renta Variable y 10% Otras Inversiones
Detalle	42,00 % IBOXX (EUR) CRP TR1-3, 19,80 % EONIA CAPIT.INDEX 7D, 10,00 % EUROSTOXX 50 NET RETURN, 6,30 % BG SERIES-E SPAIN GOVT 3-5YR, 5,60 % BG SERIES-E SPAIN GOVT 5-7YR, 4,00 % S&P 500 Net TR, 3,50 % BG SERIES-E SPAIN GOVT 1-3YR, 2,10 % BG SERIES-E SPAIN GOVT 7-10YR, 2,00 % TOPIX INDEX (TOKYO) (EUR), 2,00 % IBEX 35 Net Return, 2,00 % MSCI EM NR, 0,70 % BG SERIES-E SPAIN GOVT >10YR

INFORMACIÓN DE LA CARTERA

CARTERA DE RENTA VARIABLE

Inversión Total En Rv	25,12%
Inversión Contado	2,83%
Inversión Fondos	18,00%
Inversión Derivados	4,29%

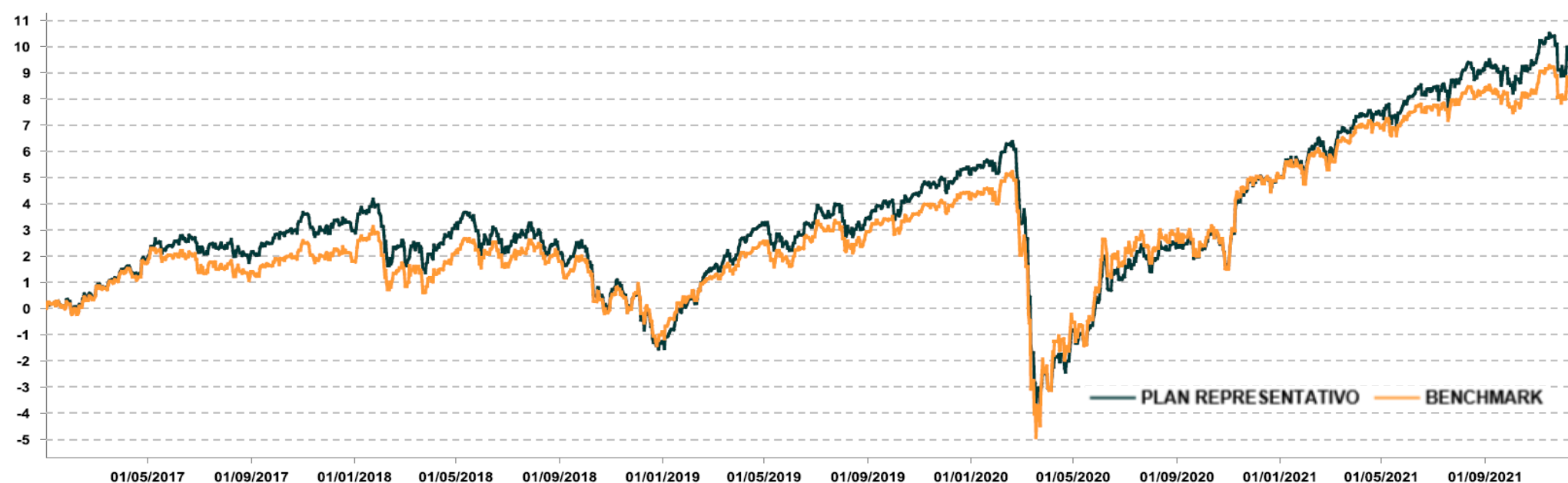
CARTERA DE RENTA FIJA

Inversión Total En Rf	65,32%
Duración Cartera Directa (años)	2,39
Vida Media Cartera Directa (años)	2,42
Tir De La Cartera	0,06
Rating Medio De La Cartera Rf	BBB
Inversión En Depósitos	16,32%

CARTERA DE OTROS

Inversión Sobre Patrimonio	9,56%
Inversión Gestión Alternativa	5,98%
Inversión Otros	3,58%

EVOLUCIÓN DE RENTABILIDADES



ANÁLISIS RENTABILIDAD-VOLATILIDAD

Plan Representativo: ADM.PUB.CANARIAS PP	1 MES	3 MESES	6 MESES	1 AÑO	YTD	2 AÑOS	3 AÑOS	5 AÑOS
Rentabilidad								
PLAN REPRESENTATIVO	1,05%	1,26%	1,57%	4,75%	4,75%	4,65%	11,42%	10,01%
BENCHMARK	0,74%	0,87%	0,98%	3,46%	3,46%	4,27%	9,60%	8,63%
Volatilidad								
PLAN REPRESENTATIVO	3,80%	3,59%	3,31%	2,94%	2,94%	4,02%	3,55%	3,25%
BENCHMARK	2,87%	2,84%	2,56%	2,41%	2,41%	4,76%	4,07%	3,54%
Ratio de Sharpe								
PLAN REPRESENTATIVO	3,71	1,59	1,13	1,82	1,82	0,72	1,20	0,77
BENCHMARK	3,44	1,45	0,99	1,68	1,68	0,57	0,90	0,64

ANÁLISIS RENTABILIDADES vs INVERCO

31-12-21



RENTABILIDADES MEDIAS ANUALES DE LOS PLANES DE PENSIONES (*) a 31/12/2021

	26 AÑOS	25 AÑOS	20 AÑOS	15 AÑOS	10 AÑOS	5 AÑOS	3 AÑOS	1 AÑO
	%	%	%	%	%	%	%	%
SISTEMA INDIVIDUAL	2,93	2,97	2,54	2,33	4,51	3,48	6,50	8,67
RENTA FIJA CORTO PLAZO	1,16	1,34	0,88	0,82	0,63	-0,35	-0,07	-0,64
RENTA FIJA LARGO PLAZO	2,63	2,03	1,80	1,85	1,85	0,06	0,84	-1,59
RENTA FIJA MIXTA	2,93	2,46	1,82	1,22	2,29	1,45	3,28	4,25
RENTA VARIABLE MIXTA	3,91	4,30	3,11	2,65	5,26	4,23	7,78	11,91
RENTA VARIABLE	3,99	4,92	4,19	4,87	10,50	9,90	17,34	23,42
GARANTIZADOS			3,79	2,65	5,93	1,97	2,67	-0,70
SISTEMA DE EMPLEO	4,29	3,75	3,53	3,28	4,72	3,61	6,12	8,09
SISTEMA ASOCIADO	5,01	4,47	3,82	3,39	5,05	3,89	6,90	9,00
TOTAL PLANES	3,62	3,28	2,95	2,69	4,59	3,52	6,39	8,50

(*) Rentabilidades NETAS de gastos y comisiones

AD.PUB.COM.AUT.CANARIAS	a/a	N.E.	3,91	1,93	3,67	4,75
-------------------------	-----	------	------	------	------	------

AD.PUB.COM.AUT.CANARIAS	Acum.	N.E.	46,85	10,01	11,42	4,75
-------------------------	-------	------	-------	-------	-------	------

Puesto en el Ranking Empleo	15 años	10 años	5 años	3 años	1 año
AD.PUB.COM.AUT.CANARIAS		417	739	785	724
Núm.Planes en el plazo	839	1.044	1.137	1.170	1.213

Cuartil	N.E.	2	3	3	3
----------------	------	---	---	---	---

ATRIBUCIÓN DE RESULTADOS a 31-12-21



411 - EMPL.PUBL.CCAA DE CANARIAS,F.P

RENTABILIDAD DEL FONDO. ANÁLISIS POR FUENTES DE OBTENCIÓN. Período: de 31/12/2020 a 31/12/2021

	Resultados	Plusvalías			Total Rentabilidad	% sobre Rentabilidad
Rentabilidad Imputada al Fondo						
RENTA VARIABLE	Resultados	Plusvalías	Dividendos			
R.V Cartera Interior	- 41,52	75.725,74	7.112,17		82.796,39	6,68
R.V Cartera Exterior	-	92.875,00	8.600,00		101.475,00	8,18
I.I.C Renta Variable	236.424,67	616.280,11	61.300,84		914.005,62	73,69
TOTAL	236.383,15	784.880,85	77.013,01		1.098.277,01	88,54
OTRAS INVERSIONES	Resultados	Plusvalías	Ingr.Financieros o Dividendos	Ingresos Plazo		
Otros Fondos de Inversion	41.462,96	- 7.403,00	4.026,40		38.086,36	3,07
TOTAL	41.462,96	- 7.403,00	4.026,40		38.086,36	3,07
RENTA FIJA Y TESORERÍA	Resultados	Plusvalías	Ingr.Financieros o Dividendos	Ingresos Plazo		
R.F Cartera Interior	- 86.329,34	- 70.078,71	95.478,76	19.885,36	- 41.043,93	- 3,31
R.F Cartera Exterior	- 38.871,72	- 56.926,86	112.936,09	-26.924,29	- 9.786,78	- 0,79
TOTAL	-125.201,06	-127.005,57	208.414,85	- 7.038,93	- 50.830,71	- 4,10
FUTUROS	Resultados					
Futuros IBEX	49.671,90				49.671,90	4,00
Futuros EUROSTOXX	108.047,50				108.047,50	8,71
Otros Futuros	- 2.860,00				- 2.860,00	- 0,23
TOTAL	154.859,40				154.859,40	12,48
Rentabilidad por Cartera de Valores					1.240.392,06	100,00

EVOLUCIÓN HISTÓRICA FONDO a 13 años



Evolución anual comparada Empl.Púb.CCAA Canarias FP													
Año	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fondo	5,73%	0,33%	2,97%	6,15%	10,72%	8,32%	2,04%	2,75%	2,97%	-4,11%	6,47%	-0,10%	4,75%
Benchmark	3,50%	-1,32%	1,67%	3,98%	7,46%	7,19%	1,94%	1,78%	1,81%	-2,68%	5,11%	0,79%	3,46%
INVERCO RFM	6,05%	-1,54%	-2,21%	5,41%	6,11%	3,61%	0,78%	0,71%	1,50%	-4,08%	5,14%	-0,39%	4,25%
INV. Rent.Med.PSI	6,76%	-1,43%	-1,17%	5,70%	8,75%	6,80%	1,21%	1,69%	2,56%	-4,48%	8,81%	0,30%	8,67%
INVERCO Empleo	9,28%	2,01%	0,00%	8,04%	7,70%	7,14%	2,88%	2,75%	3,19%	-3,19%	8,74%	1,53%	8,09%
IPC	0,80%	3,00%	2,40%	2,90%	0,30%	-1,00%	0,00%	1,60%	1,10%	1,20%	0,80%	-0,50%	6,50%
IPC€ a/a	0,90%	2,20%	2,80%	2,20%	0,80%	-0,20%	0,20%	1,10%	1,40%	1,60%	1,30%	-0,30%	5,00%

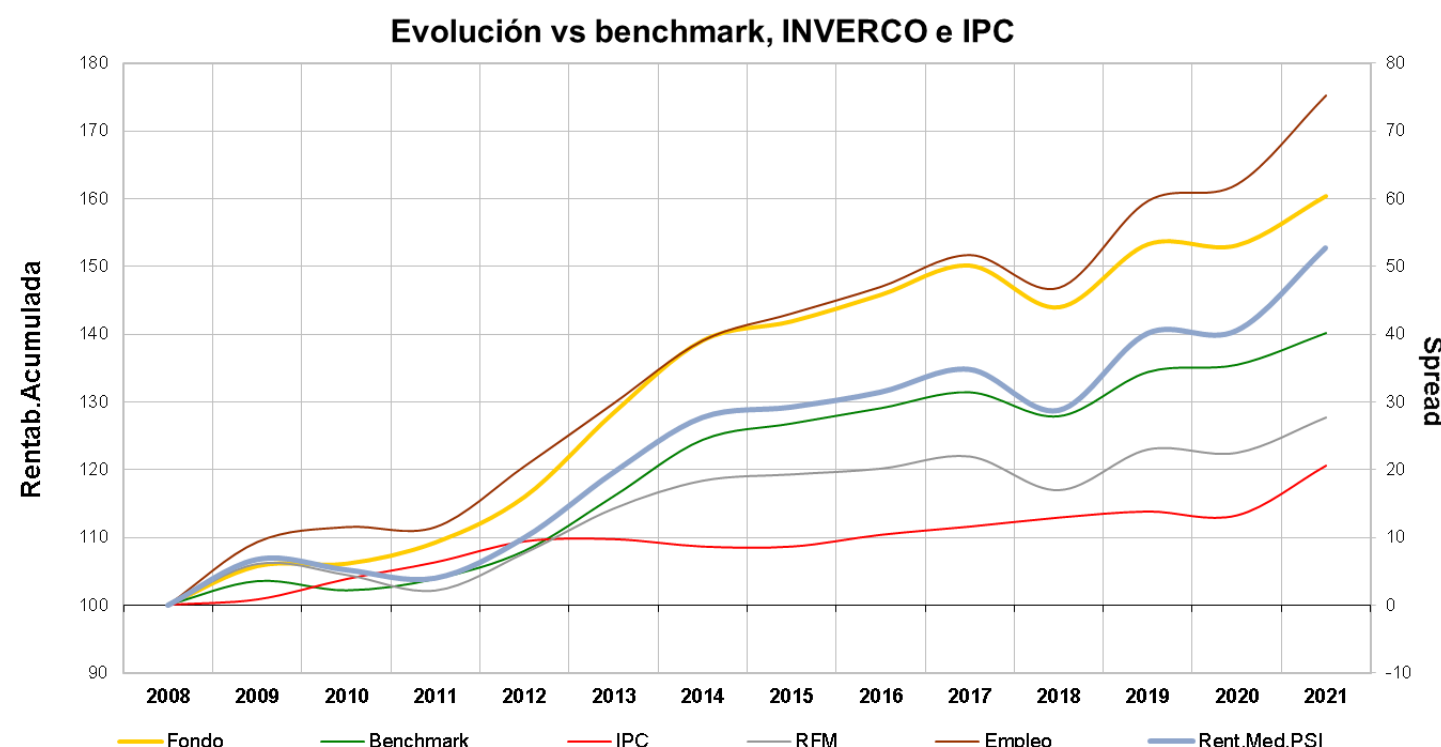
Sombreado Verde Fdo.> Índice comparado. Rojo Fdo.< Índice comparado. Negrita Fdo.bate a todo

Evolución acumulada últimos 13 años (Base 100 = 31.12.2008)													
Año	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fondo	105,73	106,08	109,22	115,96	128,39	139,07	141,91	145,83	150,16	143,99	153,31	153,15	160,43
Benchmark	103,50	102,13	103,84	107,98	116,04	124,38	126,80	129,06	131,39	127,87	134,41	135,47	140,16
INVERCO RFM	106,05	104,42	102,11	107,65	114,23	118,35	119,27	120,12	121,92	116,95	122,96	122,48	127,69
INV. Rent.Med.PSI	106,76	105,23	104,00	109,95	119,57	127,70	129,24	131,43	134,80	128,76	140,10	140,52	152,71
INVERCO Empleo	109,28	111,48	111,48	120,46	129,74	139,00	143,01	146,95	151,64	146,80	159,63	162,08	175,19
IPC	100,80	103,82	106,32	109,41	109,74	108,64	108,64	110,38	111,60	112,93	113,84	113,27	120,63
IPC€ a/a	100,90	103,12	106,01	108,35	109,21	108,99	109,21	110,42	111,96	113,75	115,23	114,89	120,63

TAE
31-12-20
3,70
2,63
1,90
3,31
4,40
1,45
1,45

Dif.Fdo.Bench.	2,23	3,94	5,38	7,98	12,35	14,69	15,12	16,77	18,76	16,12	18,90	17,68	20,27
----------------	------	------	------	------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

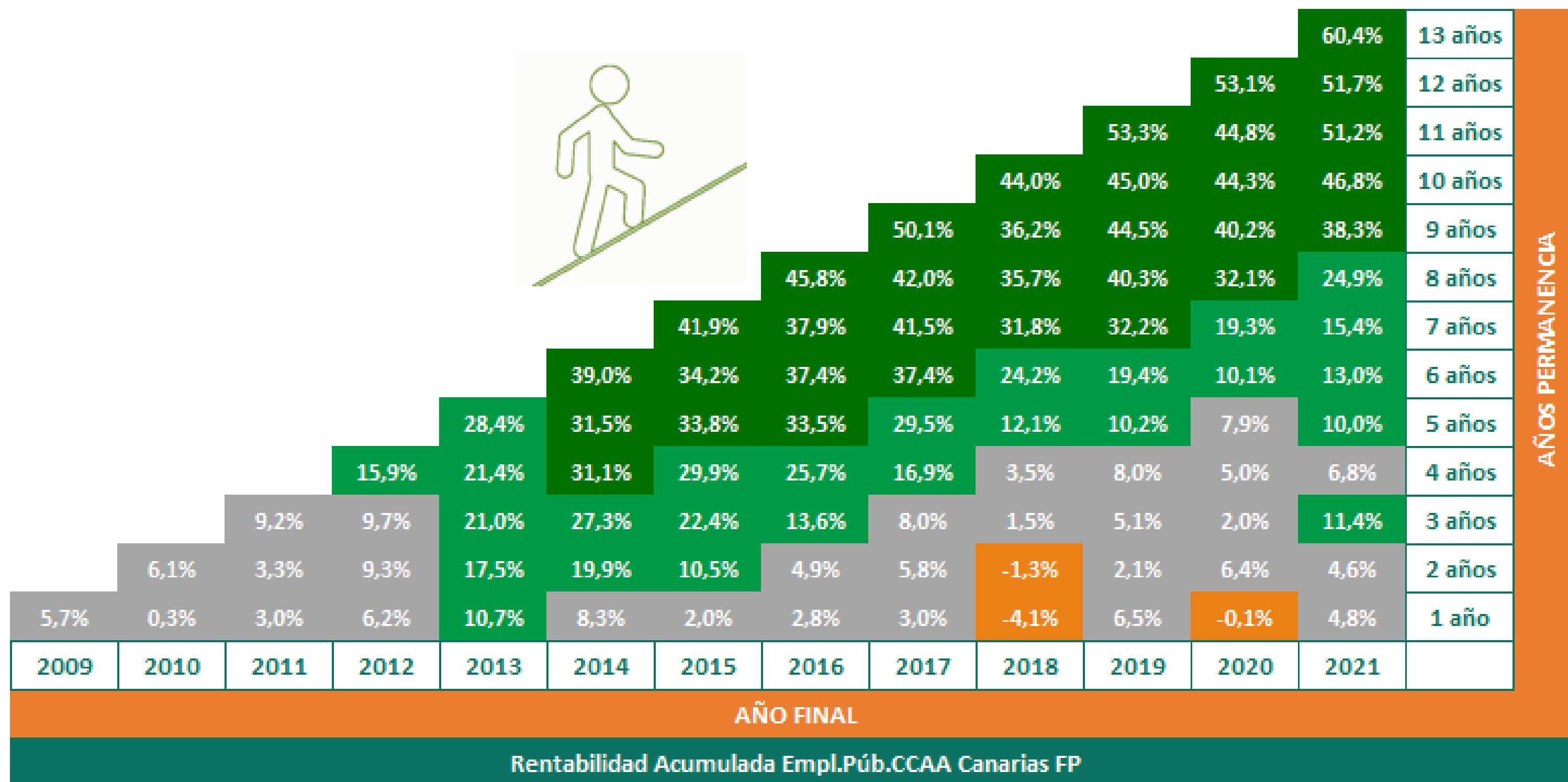
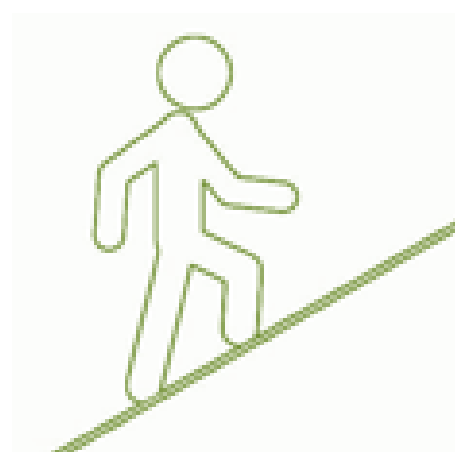
Rentabilidades financieras netas de comisiones y gastos. La rentab.fiscal del producto se añade a la financiera según base imponible



Conclusiones

- Fondo supera a Benchmark en 11 de 13 años
- Fondo supera a INVERCO RFM en 11 de 13 años
- Fondo supera a INV. Rent.Med.PSI en 9 de 13 años
- Fondo supera a INVERCO Empleo en 4 de 13 años
- Fondo supera a IPC en 10 de 13 años
- Fondo supera a IPC€ a/a en 10 de 13 años
- Fondo supera a todos los indicadores en 4 de 13 años

ESCALERA DE RENTABILIDADES



Ejemplo: Rentabilidad acumulada al final de 2020 si permanezco en el Fondo 10 años **44,3%**



FICHA DEL FONDO a 31-03-22



INFORMACIÓN DEL FONDO

Fecha de Constitución	07/11/2005
Entidad Depositaria	CECABANK, S. A.
Valor Liquidativo	9,335322
Patrimonio	24.943.025,47
Composición Benchmark	65% Renta Fija, 25% Renta Variable y 10% Otras Inversiones
Detalle	39,00 % IBOXX (EUR) CRP TR1-3, 19,10 % ESTR ECB Capitalizado, 12,50 % EUROSTOXX 50 NET RETURN, 5,85 % BG SERIES-E SPAIN GOVT 3-5YR, 5,20 % BG SERIES-E SPAIN GOVT 5-7YR, 5,00 % S&P 500 Net TR, 3,25 % BG SERIES-E SPAIN GOVT 1-3YR, 2,50 % TOPIX INDEX (TOKYO) (EUR), 2,50 % IBEX 35 Net Return, 2,50 % MSCI EM NR, 1,95 % BG SERIES-E SPAIN GOVT 7-10YR, 0,65 % BG SERIES-E SPAIN GOVT >10YR

INFORMACIÓN DE LA CARTERA

CARTERA DE RENTA VARIABLE

Inversión Total En Rv	23,84%
Inversión Contado	7,36%
Inversión Fondos	13,15%
Inversión Derivados	3,33%

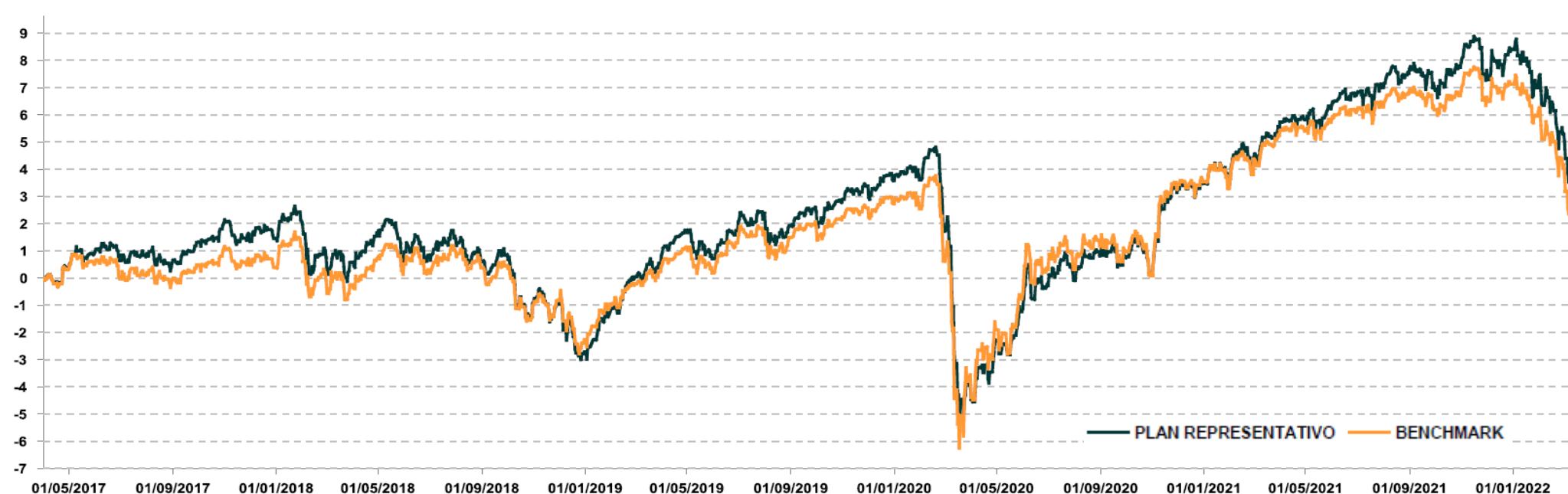
CARTERA DE RENTA FIJA

Inversión Total En Rf	66,96%
Duración Cartera Directa (años)	2,33
Vida Media Cartera Directa (años)	2,40
Tir De La Cartera	0,41
Rating Medio De La Cartera Rf	BBB
Inversión En Depósitos	14,68%

CARTERA DE OTROS

Inversión Sobre Patrimonio	9,20%
Inversión Otros	9,20%

EVOLUCIÓN DE RENTABILIDADES



ANÁLISIS RENTABILIDAD-VOLATILIDAD

Plan Representativo: ADM.PUB.CANARIAS PP	1 MES	3 MESES	6 MESES	1 AÑO	YTD	2 AÑOS	3 AÑOS	5 AÑOS
Rentabilidad								
PLAN REPRESENTATIVO	-0,37%	-3,00%	-1,78%	-0,41%	-3,00%	9,46%	4,57%	5,14%
BENCHMARK	-0,37%	-2,95%	-2,11%	-1,21%	-2,95%	7,79%	3,71%	3,95%
Volatilidad								
PLAN REPRESENTATIVO	5,05%	4,93%	4,33%	3,62%	4,93%	3,50%	3,76%	3,41%
BENCHMARK	6,25%	5,05%	4,10%	3,28%	5,05%	3,83%	4,28%	3,69%
Ratio de Sharpe								
PLAN REPRESENTATIVO	-0,77	-2,27	-0,69	0,05	-2,27	1,49	0,55	0,46
BENCHMARK	-0,62	-2,18	-0,88	-0,19	-2,18	1,15	0,42	0,37

Rentabilidad acumulada a fecha 12-04-22: Fondo: % vs Benchmark: %. Dif.: pb

ANÁLISIS RENTABILIDADES vs INVERCO

28-02-22



Rentabilidades medias anuales ponderadas (%). NETAS de gastos y comisiones

SISTEMA INDIVIDUAL	26 AÑOS	25 AÑOS	20 AÑOS	15 AÑOS	10 AÑOS	5 AÑOS	3 AÑOS	1 AÑO
Renta Fija Corto Plazo	1,1%	1,2%	0,8%	0,7%	0,3%	-0,6%	-0,5%	-1,5%
Renta Fija Largo Plazo	2,5%	1,9%	1,7%	1,7%	1,4%	-0,2%	0,0%	-2,3%
Renta Fija Mixta	2,7%	2,3%	1,7%	1,0%	1,7%	0,7%	1,3%	1,0%
Renta Variable Mixta	4,3%	3,9%	3,0%	2,3%	4,3%	2,9%	4,3%	5,8%
Renta Variable			3,9%	4,3%	8,9%	7,4%	10,5%	11,5%
Garantizados				2,6%	5,3%	2,0%	1,6%	-1,6%
TOTAL PLANES	3,1%	2,8%	2,4%	2,0%	3,6%	2,3%	3,5%	3,5%

AD.PUB.COM.AUT.CANARIAS

a/a

N.E

3,33

1,28

1,81

1,47

AD.PUB.COM.AUT.CANARIAS

Acum.

N.E.

38,85

6,55

5,54

1,47

ATRIBUCIÓN DE RESULTADOS a 31-03-22



411 - EMPL.PUBL.CCAA DE CANARIAS,F.P

RENTABILIDAD DEL FONDO. ANÁLISIS POR FUENTES DE OBTENCIÓN. Período: de 31/12/2021 a 31/03/2022

					Total Rentabilidad	% sobre Rentabilidad
Resultados		Plusvalías				
Rentabilidad Imputada al Fondo						
RENTA VARIABLE						
	Resultados	Plusvalías	Dividendos			
R.V Cartera Interior	- 13.499,91	17.054,55	1.609,20		5.163,84	- 0,67
R.V Cartera Exterior	- 63.613,40	52.946,24	897,60		- 9.769,56	1,27
I.I.C Renta Variable	-224.764,05	- 88.306,51	4.715,81		-308.354,75	40,09
TOTAL	-301.877,36	- 18.305,72	7.222,61		-312.960,47	40,69
OTRAS INVERSIONES						
	Resultados	Plusvalías	Ingr.Financieros o Dividendos	Ingresos Plazo		
Otros Fondos de Inversion	- 10.983,45	- 27.963,91	960,91		- 37.986,45	4,94
TOTAL	- 10.983,45	- 27.963,91	960,91		- 37.986,45	4,94
RENTA FIJA Y TESORERÍA						
	Resultados	Plusvalías	Ingr.Financieros o Dividendos	Ingresos Plazo		
R.F Cartera Interior	- 64.538,77	- 76.553,64	-	5.930,76	-135.161,65	17,57
R.F Cartera Exterior	- 22.838,46	-160.241,35	31.894,64	-3.304,50	-154.489,67	20,08
TOTAL	- 87.377,23	-236.794,99	31.894,64	2.626,26	-289.651,32	37,66
FUTUROS						
	Resultados					
Futuros IBEX	- 6.135,00				- 6.135,00	0,80
Futuros EUROSTOXX	-124.844,90				-124.844,90	16,23
Futuros Divisas	4.669,96				4.669,96	- 0,61
Otros Futuros	- 2.300,00				- 2.300,00	0,30
TOTAL	-128.609,94				-128.609,94	16,72
Rentabilidad por Cartera de Valores					-769.208,18	100,00

SEGMENTACIÓN DE LA CARTERA

31.03.22



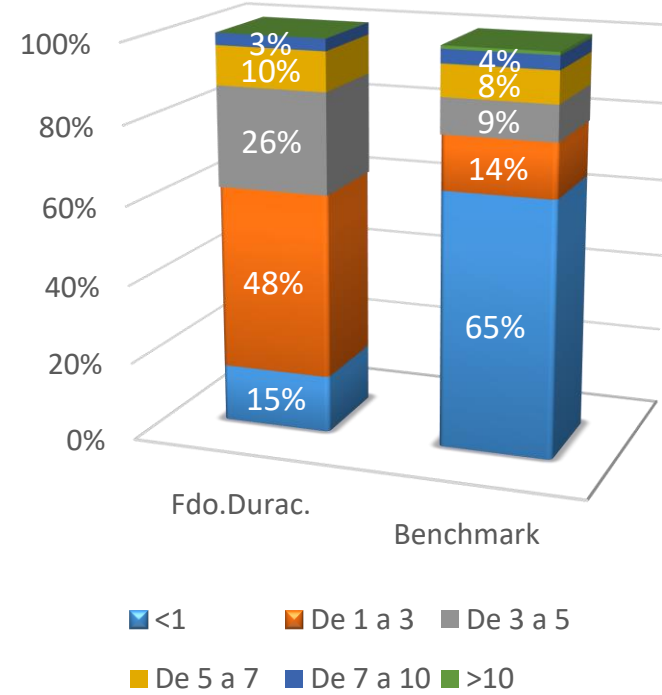
Cartera



■ Renta Fija
 ■ Renta Variable
 ■ Otras Inversiones

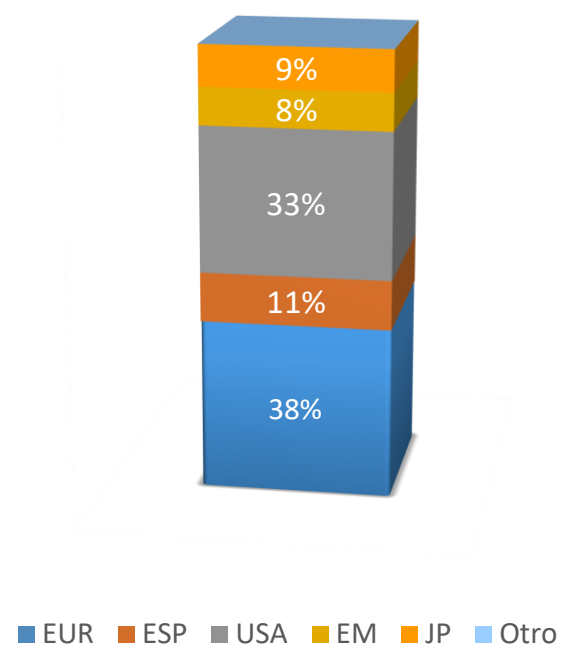
RENDA FIJA

Duraciones

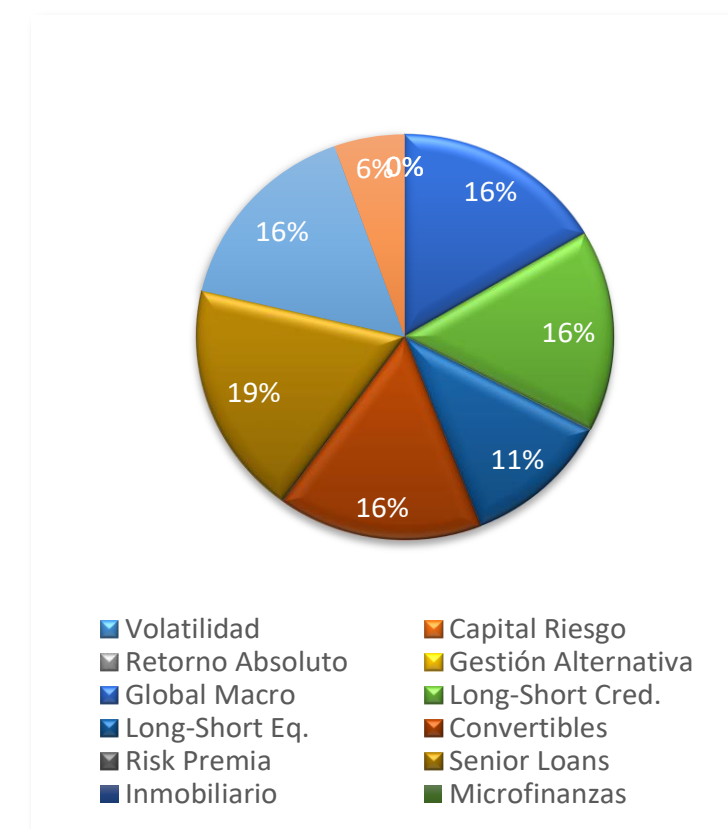


RENDA VARIABLE

Distr.Geográfica RV



OTRAS INVERSIONES



DETALLE CARTERA ACTUAL

Renta Fija



INVENTARIO DE CARTERA VALORADO A 31.3.2022

Títulos de Renta Fija EMPLEADOS PUBLICOS DE LA COMUNIDAD AUTONOMA DE CANARIAS FOND (4098)

Cód.ISIN	DESCRIPCIÓN	F.Vto.	Moody's	S&P	Fitch	Duración	Plazo	NOMINAL	Coste Efectivo	Cambio Valoración	Intereses Devengados	Efectivo Valoración	% sobre Patrimonio	Plusvalía	Minusvalía	Pluv./Minusv.
						2,95		13.763.237,58	14.022.596,05			13.879.150,85	55,64	121.428,86	-258.755,83	-136.833,61
ES0505087595	PAGARE FORTIA 11/04/2022 (13375)	11-04-22		A-		0,03	0,03	200.000,00	199.980,06	99,991	0,009	200.000,75	0,80	1,99	0,00	1,99
US00287YAL39	ABBVIE INC 2.9 11/06/22 (11672)	06-11-22	Baa2	BBB+		0,60	0,60	154.229,98	157.552,10	100,691	1,157	155.961,95	0,63	0,00	-685,40	-685,40
XS1759603761	PSGSM 1 02/08/23 (12035)	08-11-22		BBB		0,61	0,61	300.000,00	302.100,00	100,556	0,140	302.087,18	1,21	359,99	0,00	359,99
XS1767930826	FORD MOTOR CREDIT CO 03/06/2021 (13186)	07-12-22	Ba2	BB+	BB+	0,70	0,69	200.000,00	199.800,00	99,759	0,000	199.518,00	0,80	0,00	-356,48	-356,48
XS2071622216	CCK 0 3/4 02/23 (13562)	15-02-23	Ba2	BB+		0,87	0,88	200.000,00	199.550,00	99,646	0,094	199.479,50	0,80	0,00	-309,07	-309,07
XS2013574202	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 17022023 (1302)	17-02-23	Ba2	BB+	BB+	0,88	0,88	300.000,00	304.290,00	100,275	0,174	301.347,64	1,21	0,00	-1.425,18	-1.425,18
ES0505087736	PAGARE FORTIA 10/03/2023 (13619)	10-03-23		A-		0,94	0,94	300.000,00	299.102,69	99,488	0,020	298.522,93	1,20	0,00	-638,63	-638,63
ES050511348	PAGARE EL CORTE INGLES 30/03/2023 (13011)	30-03-23				1,00	1,00	200.000,00	198.017,61	98,611	0,494	198.210,39	0,79	0,00	-794,82	-794,82
XS1398336351	MRLSM 2.225 04/25/23 (9879)	25-04-23		BBB		1,05	1,07	400.000,00	422.280,00	101,537	2,073	414.438,41	1,66	115,22	0,00	115,22
XS1551678409	TITIM2 /2 07/23 (12890)	19-07-23	Ba3	BB-	BB	1,28	1,30	300.000,00	314.580,00	101,226	1,747	308.917,73	1,24	0,00	-4.390,18	-4.390,18
XS1896851224	TSCOLN 1 3/8 10/24/23 (12084)	24-07-23	Baa3	BBB-	BBB-	1,31	1,32	300.000,00	307.290,00	101,132	0,595	305.181,62	1,22	212,28	0,00	212,28
XS2081491727	FCCSER 0,815 12/04/23 (11862)	04-09-23			BBB-	1,42	1,43	200.000,00	200.000,00	100,303	0,261	201.128,49	0,81	609,12	0,00	609,12
XS1936308391	MTNA 2 1/4 01/2024 (12961)	17-01-24	Baa3	BBB-	BBB-	0,00	1,80	150.000,00	153.555,00	102,192	0,450	153.963,00	0,62	0,00	-211,52	-211,52
XS1026109204	FREGR 4 02/01/24 (12492)	01-02-24	Baa3	BBB	BBB-	1,78	1,84	250.000,00	281.175,00	105,684	0,656	265.848,89	1,07	0,00	-2.094,11	-2.094,11
XS2122902468	ACCIONA FINAN 0,737 18/02/24 (13075)	18-02-24				1,88	1,89	200.000,00	198.400,00	98,330	0,579	197.816,26	0,79	0,00	-1.230,66	-1.230,66
XS2128498636	LIGHT 2 05/11/24 (12281)	11-05-24	Baa3	BBB-		2,06	2,12	100.000,00	99.582,00	101,864	1,775	103.639,34	0,42	2.325,76	0,00	2.325,76
XS2066706818	ENEL FINANCE INTL NV (11777)	17-05-24	Baa1	BBB+	BBB+	2,13	2,13	300.000,00	299.200,00	98,319	0,000	294.957,00	1,18	0,00	-4.645,69	-4.645,69
XS2193734733	DELL 1,5/8 06/2024 (13568)	24-06-24	Baa3			2,19	2,24	300.000,00	309.720,00	101,160	1,247	307.219,73	1,23	0,00	-5.577,79	-5.577,79
XS2199265617	BAYNGR 0 3/8 07/06/24 (12454)	06-07-24	Baa2	BBB	BBB+	2,26	2,27	500.000,00	502.430,00	99,135	0,275	497.051,71	1,99	0,00	-6.217,78	-6.217,78
XS2343821794	VW 0 07/19/24 (13124)	19-07-24	A3	BBB+		2,30	2,30	200.000,00	199.500,00	97,501	0,000	195.002,00	0,78	0,00	-4.536,50	-4.536,50
XS1651444140	ERFFP 2 1/8 2024 (12725)	25-07-24	Baa3			2,26	2,32	124.000,00	132.196,40	102,206	1,450	128.533,02	0,52	0,00	-1.803,59	-1.803,59
XS2241090088	REPSM 0 1/8 10/05/24 (12601)	05-10-24	Baa2	BBB	BBB	2,52	2,52	200.000,00	199.506,00	98,444	0,061	197.009,23	0,79	0,00	-2.776,95	-2.776,95
FR0013509627	DECFP 2 10/24/24 (12218)	24-10-24	Baa3	BBB-		2,51	2,57	300.000,00	313.994,00	101,923	0,863	308.356,91	1,24	0,00	-4.402,26	-4.402,26
XS1996435688	CEPSA FINANCE SA (11526)	16-11-24	Baa3	BBB-	BBB-	2,61	2,63	400.000,00	409.686,00	98,851	0,118	395.875,23	1,59	0,00	-12.602,17	-12.602,17
XS2413696761	INTNED 0 1/8 (13467)	29-11-24	Baa1	A-	A+	2,66	2,67	100.000,00	99.839,00	97,144	0,042	97.185,78	0,39	0,00	-2.712,51	-2.712,51
XS1732232340	DT 0 5/8 12/13/24 (13621)	13-12-24	Baa1	BBB	BBB+	2,69	2,71	200.000,00	200.560,00	99,623	0,185	199.615,86	0,80	0,00	-1.302,36	-1.302,36
XS2343532417	ANASM 1.2 01/25 (13123)	14-01-25				2,76	2,79	200.000,00	201.402,84	98,143	0,092	196.470,24	0,79	0,00	-5.116,62	-5.116,62
ES0000012F92	SPGB 0 01/31/25 (12355)	31-01-25	Baa1		A-	2,84	2,84	200.000,00	198.800,00	98,869	0,000	197.738,06	0,79	0,00	-1.069,99	-1.069,99
XS2443921056	IFXGR 0 5/8 02/2025 (13587)	17-02-25		BBB		2,87	2,89	200.000,00	199.465,00	99,090	0,072	198.323,84	0,80	0,00	-1.304,68	-1.304,68
ES0317046003	TDA 6 3 7/8 2025 (13596)	23-05-25	Aa1	BBB+	A-	2,94	3,15	500.000,00	554.700,00	109,203	3,312	562.576,64	2,26	0,00	-6.947,78	-6.947,78
FR0014009A50	BFCM 1 05/23/25 (13627)	23-05-25	Aa3	A+	AA-	3,11	3,15	100.000,00	99.932,00	99,751	0,022	99.772,92	0,40	0,00	-181,32	-181,32
FR0014003Z81	CAFP 0,107 06/14/25 (13196)	14-06-25	Baa1	BBB		3,20	3,21	500.000,00	500.010,00	95,620	0,085	478.525,07	1,92	0,00	-21.883,99	-21.883,99
PTOTVMOE0000	PGB FLOAT 23/07/2025 (11655)	23-07-25	Baa2		BBB	3,31	3,32	270.000,00	283.546,00	103,610	0,186	280.249,50	1,12	0,00	-515,79	-515,79
XS0526718761	ICO E/7-10 FLOAT VTO 29-07-2025 (6819)	29-07-25	Baa1	A	A-	2,92	3,33	770.000,00	801.504,34	119,146	0,234	919.229,28	3,69	115.919,67	0,00	115.919,67
XS2345784057	BANK OF AMER.C. 08/24/25 (13160)	24-08-25	A2	A-	AA-	3,43	3,40	500.000,00	509.260,00	100,715	0,042	503.786,94	2,02	0,00	-3.761,02	-3.761,02
ES0378641353	FADE0,01 09/17/25 (12443)	17-09-25	Baa1	A	A-	3,47	3,47	300.000,00	299.157,00	97,785	0,005	293.371,03	1,18	0,00	-6.081,15	-6.081,15
XS2354444023	JDE PEETS NV 16/12/2025 (13200)	16-12-25	Baa3	BBB-	BBB-	3,71	3,72	200.000,00	198.994,00	94,319	0,000	188.638,00	0,76	0,00	-10.531,07	-10.531,07
ES0000012G91	SPGB 0 01/31/26 (13184)	31-01-26	Baa1		A-	3,84	3,84	394.000,00	400.425,41	97,441	0,000	383.917,54	1,54	0,00	-15.551,97	-15.551,97
XS2202744384	CEPSA 2 1/4 (12468)	13-02-26	Baa3	BBB-	BBB-	3,74	3,88	100.000,00	99.638,00	101,455	0,278	101.733,16	0,41	1.884,83	0,00	1.884,83
XS2322254165	GS 19/03/26 (13023)	19-03-26	A2	BBB+	A	3,99	3,97	400.000,00	407.460,00	100,250	0,014	401.056,33	1,61	0,00	-5.205,00	-5.205,00
EU000A3KTGV8	EU 0 07/06/26 (13451)	06-07-26	Aaa	AA	AAA	4,27	4,27	750.000,00	760.675,00	97,442	0,000	730.815,00	2,93	0,00	-29.108,53	-29.108,53
ES0313814016	BFTH 9 A2P 16/04/2027 (8877)	16-04-27	Aa1		AAA	5,00	5,05	104.007,60	97.869,71	98,688	-4,232	98.241,49	0,39	0,00	-5.766,40	-5.766,40
ES0001352592	JUNGAL 0,084 07/27 (12594)	30-07-27	Baa1	A		5,32	5,33	200.000,00	200.000,00	95,039	0,056	190.189,69	0,76	0,00	-9.922,01	-9.922,01
ES0000012G26	SPGB 0,8 7/30/27 (12163)	30-07-27	Baa1		A-	5,22	5,33	486.000,00	510.718,58	99,452	0,535	485.935,82	1,95	0,00	-22.492,35	-22.492,35
ES0000012I08	SPGB 0 01/31/28 (13329)	31-01-28	Baa1		A-	5,84	5,84	747.000,00	734.049,00	94,684	0,000	707.289,48	2,84	0,00	-26.858,30	-26.858,30
ES0000012F76	SPGB 0 1/2 04/30/30 (11969)	30-04-30	Baa1		A-	7,91	8,09	160.000,00	165.008,00	95,062	0,459	152.833,45	0,61	0,00	-12.585,50	-12.585,50
ES0000012I32	SPGB 31/10/2031 (13226)	31-10-31	Baa1		A-	9,36	9,59	231.000,00	223.476,37	92,344	0,207	213.792,46	0,86	0,00	-10.230,34	-10.230,34
ES0000012K20	SPGB 0,7 04/30/32 (13521)	30-04-32	Baa1		A-	9,76	10,09	73.000,00	72.618,94	92,734	0,138	67.796,36	0,27	0,00	-4.928,37	-4.928,37

DETALLE CARTERA ACTUAL

Renta Variable



INVENTARIO DE CARTERA VALORADO A 31.3.2022

Títulos de Renta Fija EMPLEADOS PUBLICOS DE LA COMUNIDAD AUTONOMA DE CANARIAS FOND (4098)

Cód.ISIN	DESCRIPCIÓN	F.Vto.	Moody's	S&P	Fitch	Duración	Plazo	NOMINAL	Coste Efectivo	Cambio Valoración	Intereses Devengados	Efectivo Valoración	% sobre Patrimonio	Plusvalía	Minusvalía	Pluv./Minusv.
ES0505087595	PAGARE FORTIA 11/04/2022 (13375)	11-04-22		A-		0,03	0,03	200.000,00	199.980,06	99,991	0,009	200.000,75	0,80	1,99	0,00	1,99
US00287YAL39	ABBVIE INC 2.9 11/06/22 (11672)	06-11-22	Baa2	BBB+		0,60	0,60	154.229,98	157.552,10	100,691	1,157	155.961,95	0,63	0,00	-685,40	-685,40
XS1759603761	PSGSM 1 02/08/23 (12035)	08-11-22		BBB		0,61	0,61	300.000,00	302.100,00	100,556	0,140	302.087,18	1,21	359,99	0,00	359,99
XS1767930826	FORD MOTOR CREDIT CO 03/06/2021 (13186)	07-12-22	Ba2	BB+	BB+	0,70	0,69	200.000,00	199.800,00	99,759	0,000	199.518,00	0,80	0,00	-356,48	-356,48
XS2071622216	CCK 0 3/4 02/23 (13562)	15-02-23	Ba2	BB+		0,87	0,88	200.000,00	199.550,00	99,646	0,094	199.479,50	0,80	0,00	-309,07	-309,07
XS2013574202	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 17022023 (13021)	17-02-23	Ba2	BB+	BB+	0,88	0,88	300.000,00	304.290,00	100,275	0,174	301.347,64	1,21	0,00	-1.425,18	-1.425,18
ES0505087736	PAGARE FORTIA 10/03/2023 (13619)	10-03-23		A-		0,94	0,94	300.000,00	299.102,69	99,488	0,020	298.522,93	1,20	0,00	-638,63	-638,63
ES0505113418	PAGARE EL CORTE INGLES 30/03/2023 (13011)	30-03-23				1,00	1,00	200.000,00	198.017,61	98,611	0,494	198.210,39	0,79	0,00	-794,82	-794,82
XS1398336351	MRLSM 2.225 04/25/23 (9879)	25-04-23		BBB		1,05	1,07	400.000,00	422.280,00	101,537	2,073	414.438,41	1,66	115,22	0,00	115,22
XS1551678409	TTIM2 /2 07/23 (12890)	19-07-23	Ba3	BB-	BB	1,28	1,30	300.000,00	314.580,00	101,226	1,747	308.917,73	1,24	0,00	-4.390,18	-4.390,18
XS1896851224	TSCOLN 1 3/8 10/24/23 (12084)	24-07-23	Baa3	BBB-	BBB-	1,31	1,32	300.000,00	307.290,00	101,132	0,595	305.181,62	1,22	212,28	0,00	212,28
XS2081491727	FCCSER 0,815 12/04/23 (11862)	04-09-23			BBB-	1,42	1,43	200.000,00	200.000,00	100,303	0,261	201.128,49	0,81	609,12	0,00	609,12
XS1936308391	MTNA 2 1/4 01/2024 (12961)	17-01-24	Baa3	BBB-	BBB-	0,00	1,80	150.000,00	153.555,00	102,192	0,450	153.963,00	0,62	0,00	-211,52	-211,52
XS1026109204	FREGR 4 02/01/24 (12492)	01-02-24	Baa3	BBB	BBB-	1,78	1,84	250.000,00	281.175,00	105,684	0,656	265.848,89	1,07	0,00	-2.094,11	-2.094,11
XS2122902468	ACCIONA FINAN 0,737 18/02/24 (13075)	18-02-24				1,88	1,89	200.000,00	198.400,00	98,330	0,579	197.816,26	0,79	0,00	-1.230,66	-1.230,66
XS2128498636	LIGHT 2 05/11/24 (12281)	11-05-24	Baa3	BBB-		2,06	2,12	100.000,00	99.582,00	101,864	1,775	103.639,34	0,42	2.325,76	0,00	2.325,76
XS2066706818	ENEL FINANCE INTL NV (11777)	17-05-24	Baa1	BBB+	BBB+	2,13	2,13	300.000,00	299.200,00	98,319	0,000	294.957,00	1,18	0,00	-4.645,69	-4.645,69
XS2193734733	DELL 1,5/8 06/2024 (13568)	24-06-24	Baa3			2,19	2,24	300.000,00	309.720,00	101,160	1,247	307.219,73	1,23	0,00	-5.577,79	-5.577,79
XS2199265617	BAYNGR 0 3/8 07/06/24 (12454)	06-07-24	Baa2	BBB	BBB+	2,26	2,27	500.000,00	502.430,00	99,135	0,275	497.051,71	1,99	0,00	-6.217,78	-6.217,78
XS2343821794	VW 0 07/19/24 (13124)	19-07-24	A3	BBB+		2,30	2,30	200.000,00	199.500,00	97,501	0,000	195.002,00	0,78	0,00	-4.536,50	-4.536,50
XS1651444140	ERFFP 2 1/8 2024 (12725)	25-07-24	Baa3			2,26	2,32	124.000,00	132.196,40	102,206	1,450	128.533,02	0,52	0,00	-1.803,59	-1.803,59
XS2241090088	REPSM 0 1/8 10/05/24 (12601)	05-10-24	Baa2	BBB	BBB	2,52	2,52	200.000,00	199.506,00	98,444	0,061	197.009,23	0,79	0,00	-2.776,95	-2.776,95
FR0013509627	DECFP 2 10/24/24 (12218)	24-10-24	Baa3	BBB-		2,51	2,57	300.000,00	313.994,00	101,923	0,863	308.356,91	1,24	0,00	-4.402,26	-4.402,26
XS1996435688	CEPSA FINANCE SA (11526)	16-11-24	Baa3	BBB-	BBB-	2,61	2,63	400.000,00	409.686,00	98,851	0,118	395.875,23	1,59	0,00	-12.602,17	-12.602,17
XS2413696761	INTNED 0 1/8 (13467)	29-11-24	Baa1	A-	A+	2,66	2,67	100.000,00	99.839,00	97,144	0,042	97.185,78	0,39	0,00	-2.712,51	-2.712,51
XS1732232340	DT 0 5/8 12/13/24 (13621)	13-12-24	Baa1	BBB	BBB+	2,69	2,71	200.000,00	200.560,00	99,623	0,185	199.615,86	0,80	0,00	-1.302,36	-1.302,36
XS2343532417	ANASM 1.2 01/25 (13123)	14-01-25				2,76	2,79	200.000,00	201.402,84	98,143	0,092	196.470,24	0,79	0,00	-5.116,62	-5.116,62
ES0000012F92	SPGB 0 01/31/25 (12355)	31-01-25	Baa1		A-	2,84	2,84	200.000,00	198.800,00	98,869	0,000	197.738,06	0,79	0,00	-1.069,99	-1.069,99
XS2443921056	IFXGR 0 5/8 02/2025 (13587)	17-02-25		BBB		2,87	2,89	200.000,00	199.465,00	99,090	0,072	198.323,84	0,80	0,00	-1.304,68	-1.304,68
ES0317046003	TDA 6 3 7/8 2025 (13596)	23-05-25	Aa1	BBB+	A-	2,94	3,15	500.000,00	554.700,00	109,203	3,312	562.576,64	2,26	0,00	-6.947,78	-6.947,78
FR0014009A50	BFCM 1 05/23/25 (13627)	23-05-25	Aa3	A+	AA-	3,11	3,15	100.000,00	99.932,00	99,751	0,022	99.772,92	0,40	0,00	-181,32	-181,32
FR0014003Z81	CAFP 0,107 06/14/25 (13196)	14-06-25	Baa1	BBB		3,20	3,21	500.000,00	500.010,00	95,620	0,085	478.525,07	1,92	0,00	-21.883,99	-21.883,99
PTOTVMOE0000	PGB FLOAT 23/07/2025 (11655)	23-07-25	Baa2		BBB	3,31	3,32	270.000,00	283.546,00	103,610	0,186	280.249,50	1,12	0,00	-515,79	-515,79
XS0526718761	ICO E/7-10 FLOAT VTO 29-07-2025 (6819)	29-07-25	Baa1	A	A-	2,92	3,33	770.000,00	801.504,34	119,146	0,234	919.229,28	3,69	115.919,67	0,00	115.919,67
XS2345784057	BANK OF AMER.C. 08/24/25 (13160)	24-08-25	A2	A-	AA-	3,43	3,40	500.000,00	509.260,00	100,715	0,042	503.786,94	2,02	0,00	-3.761,02	-3.761,02
ES0378641353	FADE0,01 09/17/25 (12443)	17-09-25	Baa1	A	A-	3,47	3,47	300.000,00	299.157,00	97,785	0,005	293.371,03	1,18	0,00	-6.081,15	-6.081,15
XS2354444023	JDE PEETS NV 16/12/2025 (13200)	16-12-25	Baa3	BBB-	BBB-	3,71	3,72	200.000,00	198.994,00	94,319	0,000	188.638,00	0,76	0,00	-10.531,07	-10.531,07
ES0000012G91	SPGB 0 01/31/26 (13184)	31-01-26	Baa1		A-	3,84	3,84	394.000,00	400.425,41	97,441	0,000	383.917,54	1,54	0,00	-15.551,97	-15.551,97
XS2202744384	CEPSA 2 1/4 (12468)	13-02-26	Baa3	BBB-	BBB-	3,74	3,88	100.000,00	99.638,00	101,455	0,278	101.733,16	0,41	1.884,83	0,00	1.884,83
XS2322254165	GS 19/03/26 (13023)	19-03-26	A2	BBB+	A	3,99	3,97	400.000,00	407.460,00	100,250	0,014	401.056,33	1,61	0,00	-5.205,00	-5.205,00
EU000A3KTGV8	EU 0 07/06/26 (13451)	06-07-26	Aaa	AA	AAA	4,27	4,27	750.000,00	760.675,00	97,442	0,000	730.815,00	2,93	0,00	-29.108,53	-29.108,53
ES0313814016	BFTH 9 A2P 16/04/2027 (8877)	16-04-27	Aa1		AAA	5,00	5,05	104.007,60	97.869,71	98,688	-4,232	98.241,49	0,39	0,00	-5.766,40	-5.766,40
ES0001352592	JUNGAL 0,084 07/27 (12594)	30-07-27	Baa1	A		5,32	5,33	200.000,00	200.000,00	95,039	0,056	190.189,69	0,76	0,00	-9.922,01	-9.922,01
ES0000012G26	SPGB 0,8 7/30/27 (12163)	30-07-27	Baa1		A-	5,22	5,33	486.000,00	510.718,58	99,452	0,535	485.935,82	1,95	0,00	-22.492,35	-22.492,35
ES0000012I08	SPGB 0 01/31/28 (13329)	31-01-28	Baa1		A-	5,84	5,84	747.000,00	734.049,00	94,684	0,000	707.289,48	2,84	0,00	-26.858,30	-26.858,30
ES0000012F76	SPGB 0 1/2 04/30/30 (11969)	30-04-30	Baa1		A-	7,91	8,09	160.000,00	165.008,00	95,062	0,459	152.833,45	0,61	0,00	-12.585,50	-12.585,50
ES0000012I32	SPGB 31/10/2031 (13226)	31-10-31	Baa1		A-	9,36	9,59	231.000,00	223.476,37	92,344	0,207	213.792,46	0,86	0,00	-10.230,34	-10.230,34
ES0000012K20	SPGB 0,7 04/30/32 (13521)	30-04-32	Baa1		A-	9,76	10,09	73.000,00	72.618,94	92,734	0,138	67.796,36	0,27	0,00	-4.928,37	-4.928,37

DETALLE CARTERA ACTUAL

Derivados y Otras Inversiones



INVENTARIO DE CARTERA VALORADO A 31.3.2022

Derivados y Compromisos EMPLEADOS PUBLICOS DE LA COMUNIDAD AUTONOMA DE CANARIAS FOND (4098)

DESCRIPCIÓN	Tipo Valor	F.VTO.	TIT./CTOS.	Coste Efectivo	NOMINAL	Cambio Valoración	Efectivo Valoración	Plusvalía	Minusvalía	Pluv./Minusv.
KFW 0 02/18/25 (13645)	- Compromisos y Plazo (C	18-02-25	350,000	344.186,50	344.186,500	98,730	345.555,00	1.368,50	0,00	1.368,50
PGB FLOAT 23/07/2025 (11655)	- Compromisos y Plazo (v	23-07-25	117,000	121.270,50	121.501,250	103,610	121.223,70	46,80	0,00	46,80
SPGB 0 01/31/25 (12355)	- Compromisos y Plazo (v	31-01-25	200,000	197.900,00	197.900,000	98,869	197.738,06	161,94	0,00	161,94
FUT EURO STOXX 50 JUN'22 VGM2 Index (135-	Futuros Comprados	17-06-22	1,000	38.155,00	1,000	3.823,000	38.230,00	75,00	0,00	75,00
FUT IBEX 35 INDX FUTR ABR'22 IBJ2 Index (13-	Futuros Comprados	14-04-22	3,000	246.075,00	3,000	8.415,900	252.477,00	6.402,00	0,00	6.402,00
FUT SP500 MIC EMIN FUTJUN'22 HWAM2 Inde-	Futuros Comprados	17-06-22	13,000	256.648,53	11,880	4.530,750	269.100,74	12.452,21	0,00	12.452,21
FUT SP500 MIC EMIN FUTJUN'22 HWAM2 Inde-	Futuros Comprados	17-06-22	7,000	134.491,93	6,420	4.530,750	145.343,56	10.851,63	0,00	10.851,63
FUT SP500 MIC EMIN FUTJUN'22 HWAM2 Inde-	Futuros Comprados	17-06-22	1,000	19.237,21	0,920	4.530,750	20.763,38	1.526,17	0,00	1.526,17
FUT SP500 MIC EMIN FUTJUN'22 HWAM2 Inde-	Futuros Comprados	17-06-22	5,000	96.191,76	4,590	4.530,750	103.816,85	7.625,09	0,00	7.625,09

INVENTARIO DE CARTERA VALORADO A 31.3.2022

Otras Inversiones EMPLEADOS PUBLICOS DE LA COMUNIDAD AUTONOMA DE CANARIAS FOND (4098)

Cód.ISIN	DESCRIPCIÓN	TITULOS	Coste Efectivo	Cambio Valoración	Efectivo Valoración	% sobre Patrimonio	Pluv./Minusv.
LU0539144625	NORDEA EURO CON BD-BI FI (11575)	25.033,47	374.000,00	14,4	360.481,97	1,45	-13.518,03
IE00BWFRBY02	SICAV LYXOR CHEN CREDIT EUR (12906)	3.294,33	368.550,43	111,293	366.636,25	1,47	-1.914,18
LU1344621674	ALPHA UCITS SICAV OAKS DYNAMIC E EUR AC (10276)	330,33	369.699,79	1101,07	363.714,25	1,46	-5.985,54
LU2017805941	ALPHA UCITS-FOK HG CRD-M2EUR (11760)	60,38	60.524,87	995,4	60.099,27	0,24	-425,60
ES0157935000	FI ACACIA RENTA DINAMICA FI (13516)	17.502,76	125.000,00	7,10584	124.371,83	0,50	-628,17
LU0398686286	NN L ALTR BETA-PC-IH (13514)	53,06	374.995,86	7053,59	374.291,70	1,50	-704,16
LU1433232698	PICTET TR - ATLAS-I EUR FI (12852)	2.134,14	252.489,77	121,99	260.343,40	1,04	7.853,63
IE00B520F527	SICAV SALAR FUND PLC-E1E (12873)	2.235,44	370.358,62	162,01	362.163,63	1,45	-8.194,99

The logo for Caser features a stylized orange icon on the left, resembling a curved arrow or a drop, followed by the word "caser" in a bold, dark green, lowercase sans-serif font.

caser

