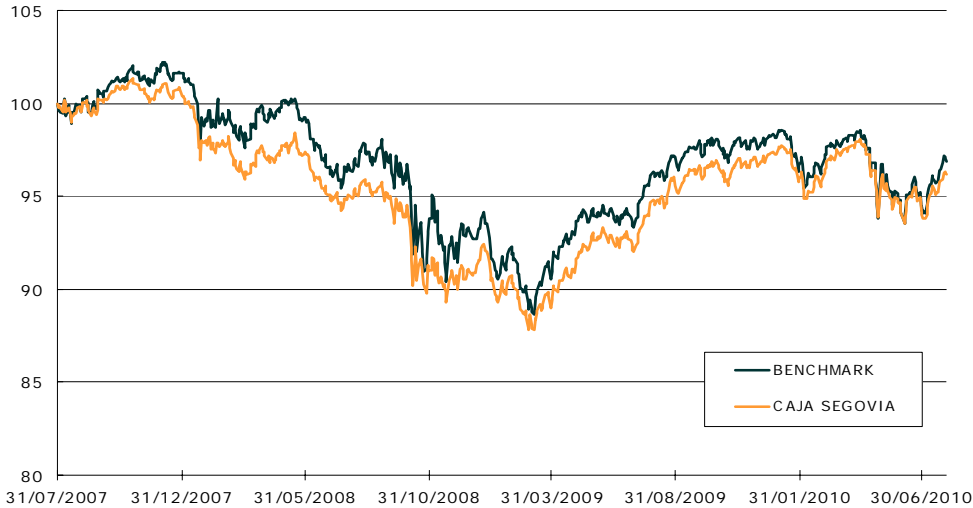


La información contenida en la presente ficha refleja la composición y evolución de la cartera y rentabilidad del fondo referenciada contra el «Benchmark» acordado por la Comisión de Control del fondo de pensiones y comunicado a la Entidad Gestora para el presente ejercicio, en base a las expectativas de evolución de la rentabilidad y seguridad de los distintos tipos de activos en el año.

EVOLUCIÓN DE RENTABILIDADES

Objetivo de Inversión

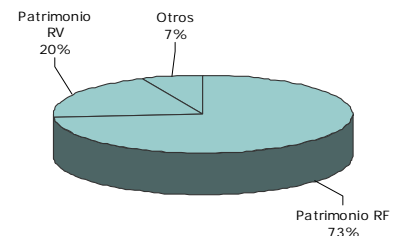
Fondo clasificado dentro de la categoría de Renta Fija Mixta (su porcentaje de inversión en renta variable es menor al 30%). La inversión en renta variable se realiza en países de la Zona Euro, con predominio de España. En cuanto al porcentaje del patrimonio en renta fija, se invertirá en Deuda Pública Nacional y Extranjera y en Renta Fija Privada Nacional y Extranjera.

ANÁLISIS RENTABILIDAD-VOLATILIDAD

Plan 1	1 MES	3 MESES	6 MESES	1 AÑO	YTD	2 AÑOS	3 AÑOS
Rentabilidad							
CAJA SEGOVIA	2,30%	-0,23%	0,31%	1,65%	-1,07%	0,84%	-3,79%
BENCHMARK	2,69%	0,13%	0,26%	0,77%	-1,36%	-0,19%	-3,15%
Volatilidad							
CAJA SEGOVIA	3,42%	6,56%	5,38%	4,52%	5,17%	5,69%	5,18%
BENCHMARK	4,18%	9,32%	7,35%	5,79%	6,98%	7,28%	6,69%
Ratio de Sharpe							
CAJA SEGOVIA	9,17	-0,14	0,12	0,37	-0,36	0,07	-0,25
BENCHMARK	8,95	0,06	0,07	0,13	-0,33	-0,01	-0,16

Información del Fondo

Fecha de Constitución	22 de diciembre de 1988
Entidad Depositaria	Caja Segovia
Valor Liquidativo	17.631
Patrimonio	29.448.962
Benchmark	21 % RV, 69 % RF, 10 % Otros
Benchmark RF	100% Combinación EFFAS y EONIA
Benchmark RV	25% Ibex 35, 75% Eurostoxx 50
Otros	100% Eonia Capitalizado

Estructura del Fondo

Información de la Cartera
Cartera de Renta Variable

Nivel de Inversión	100,11%
Cartera contado	14,52%
Cartera derivados	66,20%
Cartera opciones	0,00%
Cartera futuros	66,20%
Cartera otras inv.	19,39%

Cartera de Renta Fija

	Cartera	Benchmark
Duración (años)	2,61	2,50
Vida media	2,93	
Rentabilidad Media (%)	2,60	1,23
Posición Derivados:		
- Futuros (3 meses a 3 años)	0,0%	
- Futuros (3 a 10 años)	0,0%	
- Opciones RF	0,0%	

Cartera de Otros

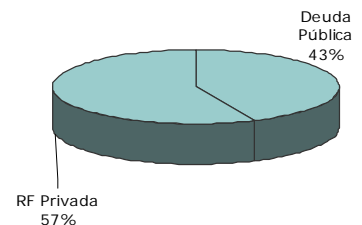
Inversión sobre patrim.	7,11%
Gestión alternativa	6,28%
Inmobiliario	0,83%

CAJA SEGOVIA, F.P.

RIESGO FRENTE AL BENCHMARK RENTA FIJA

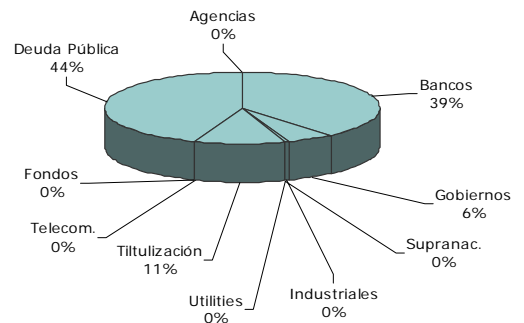
Por Plazo	Fondo	Benchmark	Riesgo
Hasta 1 año	36,13%	60,00%	-23,87%
1- 3 años	28,21%	8,00%	20,21%
3 - 5 años	10,01%	7,50%	2,51%
5 - 7 años	4,58%	8,50%	-3,92%
7 - 10 años	12,03%	10,00%	2,03%
Más de 10 años	9,04%	6,00%	3,04%

Composición por activos



Rating	Cartera	Benchmark	Riesgo
AAA	25,92%	100,00%	-74,08%
AA	55,43%	0,00%	55,43%
A	16,98%	0,00%	16,98%
BBB	1,67%	0,00%	1,67%
RS	0,00%	0,00%	0,00%

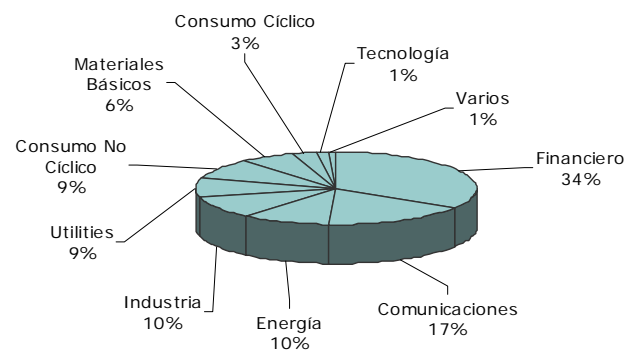
Composición sectoriales



RIESGO FRENTE AL BENCHMARK RENTA VARIABLE

Sector	Fondo	Benchmark	Riesgo
Materiales Básicos	6,38%	6,78%	-0,40%
Comunicaciones	16,83%	14,81%	2,01%
Consumo Cíclico	2,68%	3,25%	-0,57%
Consumo No Cíclico	8,83%	9,67%	-0,84%
Energía	10,30%	8,55%	1,74%
Financiero	34,12%	33,87%	0,25%
Industria	9,59%	9,90%	-0,31%
Tecnología	1,39%	1,71%	-0,32%
Utilities	8,93%	10,29%	-1,36%
Varios	0,95%	1,17%	-0,22%

Distribución geográfica



País	Cartera	Benchmark	Riesgo
España	38,18%	35,68%	2,51%
Francia	25,50%	26,59%	-1,09%
Alemania	18,68%	20,44%	-1,76%
Italia	7,34%	7,73%	-0,38%
Holanda	4,60%	4,61%	-0,01%
Portugal	1,65%	0,00%	1,65%
Luxemburgo	1,31%	1,59%	-0,28%
Bélgica	1,21%	1,49%	-0,28%
Finlandia	1,08%	1,33%	-0,25%
Irlanda	0,45%	0,55%	-0,10%

Distribución geográfica

