

Pensions Caixa 30				Mandato 2024	
Clase de activo	Bandas			Índice de referencia	
	Min.	Max.	2024		
Renta variable global	5%	25%	15%	M1WOESU	MSCI World ESG Universal Net Return USD Index
Renta variable temática	2%	8%	5%	40% SPGTCLNT + 30% NU732025 + 20% MXACIWEF + 10% SPGTTFN*	40% SPGTCLNT + 30% NU732025 + 20% MXACIWEF + 10% SPGTTFN*
Renta variable Climática	2%	8%	5%	NU723911	MSCI World ESG Enhanced Focus CTB NR USD
Renta variable países emergentes	2%	8%	5%	M1EFESU	MSCI EM (EMERGING MARKETS) ESG UNIVERSAL Net Return
<b>Total renta variable (RV)</b>	<b>15%</b>	<b>45%</b>	<b>30%</b>		
Tesorería	1%	10%	4%	LECO	ICE BofA ESTR Overnight Rate Index
<b>Total tesorería (TRE)</b>	<b>1%</b>	<b>10%</b>	<b>4%</b>		
Deuda pública zona euro	2%	14%	8%	EG00	ICE BofA Euro Government Index
Deuda pública zona no euro	2%	14%	8%	G0Q0	BofAML US Treasury 1-30 Yr USD
Deuda pública vinc. inflación	1%	6%	3%	G5QI	BofAML US Infl. Linked Treasury USD
Renta fija privada zona euro	3%	9%	6%	I29709	Bloomberg Barclays EUR 1-10 Yr Cor ESG
Renta fija privada zona no euro	1%	7%	4%	I29694	Bloomberg Barclays US 1-10 Yr Cor ESG
Renta fija países emergentes	3%	9%	6%	100% EMUSTRUU	100% Barclays EM USD Agg TR Val Uh
Renta fija privada High Yield	1%	7%	4%	I35311US	Barclays MSCI Global High Yield ESG Weighted Index
ABS (incl. Titul. y Diversif.)	1%	3%	2%	G0LL	BofAML Global Large Cap Collat. USD
Reaseguros	1%	6%	3%	PLCBFUA	Plenum CAT Bond UCITS Fund Index USD Avg
Préstamos	1%	3%	2%	IBXLLTR	Markit iBoxx Liqu Lev Loan USD
<b>Total renta fija (RF)</b>	<b>30%</b>	<b>70%</b>	<b>46%</b>		
Capital Riesgo	6%	18%	12%	M1WOESU Index + 3%	MSCI World ESG Universal + 3%
Infraestructuras	1%	4%	3%	(25% LUS0 + 75% LECO) + 4%	(25% ICE BofA SOFR Overnight Rate Index + 75% ICE BofA ESTR Overnight Rate Index) + 4%
Private Debt	0%	3%	1%	(80% SPBDEL Index + 20% IBXLLTR Index) + 1%	(80% S&P European Leveraged Loans + 20% Markit iBoxx Liqu Lev Loan USD) + 1%
Hedge Fund	1%	4%	2%	50% HFRIMTI + 50% HFRIVOL	50% HFRI Macro Systematic Diversified Index + 50% HFRI Relative Value Volatility Index
Real Estate	1%	3%	2%	LECO + 4%	ICE BofA ESTR Overnight Rate Index + 4%
<b>Total alternativos (ALT)</b>	<b>10%</b>	<b>30%</b>	<b>20%</b>		
<b>Total Activos</b>			<b>100%</b>		

Exposición Divisa	Max.	Min.	Central
USD	17,2%	28,7%	23,0%

(\*) 40% S&P Global Clean Energy Net TR + 30% MSCI World Information Technology 20-35 Net USD + 20% MSCI ACWI IMI Water ESG Filtered Net USD Index + 10% S&P Global Timber and Forestry Net Total Return Index

Con los siguientes pesos en moneda extranjera en los índices:

Pensions Caixa 30				Mandato 2024										
Clase de activo	Bandas			Índice de referencia	Divisa por Índice					Divisa por cartera				
	Min.	Max.	2024		USD	GBP	JPY	EUR	Otras	USD	GBP	JPY		
Renta variable global	5%	25%	15%	M1WOESU	64,7%	4,1%	6,8%	6,0%	18,4%	9,7%	0,6%	1,0%		
Renta variable temática	2%	8%	5%	40% SPGTCLNT + 30% NU732025 + 20% MXACIWEF + 10% SPGTTFN*	58,3%	2,3%	3,9%	6,0%	29,5%	2,9%	0,1%	0,2%		
Renta variable Climática	2%	8%	5%	NU723911	64,8%	4,2%	6,7%	6,4%	17,9%	3,2%	0,2%	0,3%		
Renta variable países emergentes	2%	8%	5%	M1EFESU					100,0%					
<b>Total renta variable (RV)</b>	<b>15%</b>	<b>45%</b>	<b>30%</b>							<b>15,9%</b>	<b>0,9%</b>	<b>1,5%</b>		
Tesorería	1%	10%	4%	LECO				100,0%						
<b>Total tesorería (TRE)</b>	<b>1%</b>	<b>10%</b>	<b>4%</b>							<b>0,0%</b>	<b>0,0%</b>	<b>0,0%</b>		
Deuda pública zona euro	2%	14%	8%	EG00				100,0%						
Deuda pública zona no euro	2%	14%	8%	G0Q0	100,0%					8,0%				
Deuda pública vinc. inflación	1%	6%	3%	G5QI	100,0%					3,0%				
Renta fija privada zona euro	3%	9%	6%	I29709				100,0%						
Renta fija privada zona no euro	1%	7%	4%	I29694	100,0%					4,0%				
Renta fija países emergentes	3%	9%	6%	100% EMUSTRUU	100,0%					6,0%				
Renta fija privada High Yield	1%	7%	4%	I35311US	76,7%	2,5%		20,2%	0,6%	3,1%	0,1%			
ABS (incl. Titul. y Diversif.)	1%	3%	2%	G0LL	87,0%	0,7%		10,3%	2,0%	1,7%	0,0%			
Reaseguros	1%	6%	3%	PLCBFUA	100,0%					3,0%				
Préstamos	1%	3%	2%	IBXLLTR	100,0%					2,0%				
<b>Total renta fija (RF)</b>	<b>30%</b>	<b>70%</b>	<b>46%</b>							<b>30,8%</b>	<b>0,1%</b>	<b>0,0%</b>		
Capital Riesgo	6%	18%	12%	M1WOESU Index + 3%	64,7%	4,1%	6,8%	6,0%	18,4%	7,8%	0,5%	0,8%		
Infraestructuras	1%	4%	3%	(25% LUS0 + 75% LECO) + 4%	25,0%			75,0%		0,8%				
Private Debt	0%	3%	1%	(80% SPBDEL Index + 20% IBXLLTR Index) + 1%	20,0%			80,0%		0,2%				
Hedge Fund	1%	4%	2%	50% HFRIMTI + 50% HFRIVOL	100,0%					2,0%				
Real Estate	1%	3%	2%	LECO + 4%				100,0%						
<b>Total alternativos (ALT)</b>	<b>10%</b>	<b>30%</b>	<b>20%</b>							<b>10,7%</b>	<b>0,5%</b>	<b>0,8%</b>		
<b>Total Activos</b>			<b>100%</b>							<b>57,4%</b>	<b>1,5%</b>	<b>2,4%</b>		

Exposición Divisa	Max.	Min.	Central
USD	17,2%	28,7%	23,0%

Para el cálculo del índice de referencia, aquellos índices que estén denominados en moneda no Euro serán transformados a Euros como moneda base para el cálculo de este. No obstante, se aplicará un rango neutral de cobertura del 60% sólo para el Dólar Americano, con bandas del +/- 10% de cobertura sobre el nivel marcado. Al citado benchmark se le añadirá el efecto del coste de los forwards en su cálculo diario, por medio de la inclusión de los puntos forwards para el dólar americano.

Si por alguna circunstancia, alguno de los índices de referencia deja de publicarse o se reformula de forma que no refleje fielmente el Mandato, se fijará un sustituto de común acuerdo entre la Entidad Gestora y la Comisión de Control.