

S.E.C.I. PATRIMONIO FONDO DE PENSIONES (Nº de Registro DGSFP: F0634).

Entidad Promotora y Gestora: Seguros El Corte Inglés, Vida, Pensiones y Reaseguros, S.A. (Nº de Registro DGSFP: G0154).

Entidad Depositaria: Santander Securities Services S.A. (Nº de Registro DGSFP: D0196).

Total activo del fondo:

DESCRIPCIÓN ACTIVO (posiciones en contado)	DIVISA	VALOR MERCADO	%
RENTA FIJA (incluye intereses a la fecha)		36.386.782,11	85,7%
RENTA FIJA DIRECTA		16.680.667,10	39,3%
España		9.374.689,28	22,1%
XS1169199152 EL CORTE INGLES S.A. BONO 3,875% 19/01/2022	EUR	1.024.157,51	2,4%
XS1886543476 EL CORTE INGLES BONO 3,00% 15/03/2024	EUR	983.670,00	2,3%
XS2156581394 REPSOL INTL FINANCE BONO 2,00% 15/12/2025	EUR	965.964,95	2,3%
XS1398336351 MERLIN PROPERTIES BONO 2,225% 25/04/2023	EUR	913.106,96	2,2%
XS1687934643 ACCIONA BONO 1,85% 22/09/2020	EUR	712.132,93	1,7%
ES0313040034 BANCA MARCH BONO INDEXADO 02/11/2021	EUR	696.028,03	1,6%
XS1562614831 BBVA 3,50% 10/02/2027 BONO 3,50% 10/02/2027	EUR	557.571,80	1,3%
XS1405136364 BANCO SABADELL BONO 5,625% 06/05/2026	EUR	516.488,01	1,2%
XS1565131213 CAIXABANK BONO INDEXADO 15/02/2027	EUR	516.312,73	1,2%
XS1809245829 INDRA SISTEMAS BONO 3,00% 19/04/2024	EUR	507.798,90	1,2%
XS1592168451 BANKINTER BONO 2,50% 06/04/2027	EUR	502.680,96	1,2%
ES0213307046 BANKIA BONO INDEXADO 15/03/2027	EUR	401.597,53	0,9%
ES0505223117 PAGARE GESTAMP AUTOMOCION BONO 05/07/2021	EUR	298.305,00	0,7%
XS2025466413 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 0,625% 15/07/2025	EUR	284.509,16	0,7%
ES0584696183 PAGARE MASMOVIL LETRA 18/09/2020	EUR	199.898,00	0,5%
XS1967635621 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 1,50% 27/06/2024	EUR	198.668,66	0,5%
ES0343307015 KUTXABANK BONO 0,50% 25/09/2024	EUR	95.798,15	0,2%
Europa		7.305.977,82	17,2%
IT0005172322 BUONI POLIENNALI DEL TES BONO 0,95% 15/03/2023	EUR	2.248.866,90	5,3%
PTOTEYOE0007 OBRIGACOES DO TESOURO BONO 3,85% 15/04/2021	EUR	834.445,15	2,0%
XS2156506854 NATURGY FINANCE BV BONO 1,25% 15/01/2026	EUR	520.761,37	1,2%
XS1586146851 SOCIETE GENERALE BONO INDEXADO 01/04/2022	EUR	400.581,00	0,9%
XS1602557495 BANK OF AMERICA BONO INDEXADO 04/05/2023	EUR	400.404,70	0,9%
FR0013416146 AUCHAN HOLDING BONO 2,375% 25/04/2025	EUR	397.969,81	0,9%
XS1633845158 LLOYDSBANKINGGROUPLCMTN BONO INDEXADO 21/06/2024	EUR	395.586,76	0,9%
FR0013260486 RCI BANQUE BONO INDEXADO 14/03/2022	EUR	390.904,00	0,9%
XS0454773713 KPN BONO 5,625% 30/09/2024	EUR	374.700,20	0,9%
XS2049726990 DEUTSCHE LUFTHANSA AG BONO 0,25% 06/09/2024	EUR	353.466,21	0,8%
FR0013477254 AIR FRANCE-KLM BONO 1,875% 16/01/2025	EUR	331.981,64	0,8%
XS1551726810 CELLNEX TELECOM BONO 2,875% 18/04/2025	EUR	321.177,00	0,8%
XS1972548231 VOLKSWAGEN BONO 1,50% 01/10/2024	EUR	305.696,56	0,7%
ES0213469580 EUROPEAN INVESTMENT BANK BONO 8,50% 17/06/2021	EUR	29.436,52	0,1%
FONDOS		19.706.115,01	46,4%
Europa		6.570.090,03	15,5%
LU1650487413 ETF LYXOR EURO GOVERNMENT BOND 1-3Y	EUR	1.944.384,00	4,6%
FR0010754135 ETF AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD	EUR	365.189,30	0,9%
LU1832969064 MS EURO CORPORATE BOND ID EUR	EUR	1.008.890,55	2,4%
LU0658026603 AXA IM FIIS EUR SH DUR HIGH YIELD	EUR	1.558.143,44	3,7%
LU1533169881 JPM EUROPE HY SHORT DUR C	EUR	1.007.455,91	2,4%
LU0726357444 PICTET EUR SHORT TERM HIGH YIELD I	EUR	686.026,83	1,6%
Otros		13.136.024,98	30,9%
LU1829331989 THREADNEEDLE 8E CREDIT OPPORTUNITIES FUND	EUR	2.691.754,66	6,3%
LU0992624949 CARMIGNAC SECURITE F	EUR	1.145.129,46	2,7%
LU1481584016 FLOSSBACH BOND OPPORTUNITIES IT	EUR	2.277.573,93	5,4%
ES0128522028 RENTA 4 VALOR RELATIVO FI, CLASE I	EUR	2.025.874,30	4,8%
LU1161526816 EDR BOND ALLOCATION-I EUR	EUR	2.007.341,29	4,7%
IE00BWGCDT37 PIMCO GIS INCOME FUND EUR HEDGED	EUR	1.927.966,88	4,5%
IE00B520F527 FEROX SALAR GLOBAL Convertible - E1 EUR Acc	EUR	1.060.384,46	2,5%

RENTA VARIABLE		700.865,80	1,7%
FONDOS		700.865,80	
Europa		700.865,80	1,7%
LU0717821077	ROBECO GLOBAL CONSUMER TRENDS	EUR	700.865,80 1,7%
OTROS		1.198.054,79	2,8%
FONDOS DE CAPITAL RIESGO		796.406,09	1,9%
ES0157100001	ALTAMAR GLOBAL VIII - FCR	EUR	782.465,08 1,8%
ES0108904030	ALTAMAR BUYOUT EUROPA	EUR	7.076,67 0,0%
ES0109933038	ARCANO CAPITAL I FCR	EUR	6.864,34 0,0%
INMOBILIARIO		401.648,70	0,9%
	HEALTHCARE ACTIVOS YIELD SOCIMI, S.A.	EUR	401.648,70 0,9%
LIQUIDEZ		EUR 3.619.560,74	8,5%

POSICIONES ABIERTAS EN DERIVADOS		872.010,93	2,1%
RENTA FIJA		0,00	0,0%
Europa		0,00	0,0%
			0,0%
			0,0%
Estados Unidos		0,00	0,0%
			0,0%
RENTA VARIABLE		872.010,93	2,1%
Europa		322.300,00	0,8%
	EURO STOXX 50 Sep20 (Posición larga)	EUR	322.300,00 0,8%
Estados Unidos		549.710,93	1,3%
	S&P500 EMINI FUT Sep20 (Posición larga)	USD	549.710,93 1,3%