

## 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	%
<b>RENTA FIJA (incluye intereses a la fecha)</b>		<b>36.780.401,12</b>	<b>84,8%</b>
<b>RENTA FIJA DIRECTA</b>		<b>16.287.520,84</b>	<b>37,6%</b>
<b>España</b>		<b>8.017.496,72</b>	<b>18,5%</b>
XS1169199152 EL CORTE INGLÉS BONO 3,875% 19/01/2022	EUR	1.096.025,75	2,5%
XS1886543476 EL CORTE INGLES BONO 3,00% 15/03/2024	EUR	1.055.360,00	2,4%
ES0313040034 BANCA MARCH BONO INDEXADO 02/11/2021	EUR	998.262,31	2,3%
XS1687934643 ACCIONA BONO 1,85% 22/09/2020	EUR	964.174,04	2,2%
XS1405136364 BANCO SABADELL BONO 5,625% 06/05/2026	EUR	597.736,11	1,4%
XS1562614831 BBVA 3,50% 10/02/2027 BONO 3,50% 10/02/2027	EUR	594.743,29	1,4%
XS1565131213 CAIXABANK BONO INDEXADO 15/02/2027	EUR	539.993,56	1,2%
ES0213307046 BANKIA BONO INDEXADO 15/03/2027	EUR	427.672,16	1,0%
XS1551726810 CELLNEX TELECOM BONO 2,875% 18/04/2025	EUR	334.626,32	0,8%
XS2034655725 PAGARE CIE AUTOMOTIVE 24/10/2019	EUR	299.982,01	0,7%
ES0505199457 PAGARE MAXAM 29/10/2019	EUR	299.935,69	0,7%
XS2025466413 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 0,625% 15/07/2025	EUR	298.783,47	0,7%
XS1967635621 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 1,50% 27/06/2024	EUR	210.170,79	0,5%
XS2060685232 PAGARE EUSKALTEL 31/01/2020	EUR	199.876,39	0,5%
ES0343307015 KUTXABANK BONO 0,50% 25/09/2024	EUR	100.154,83	0,2%
<b>Europa</b>		<b>8.270.024,12</b>	<b>19,1%</b>
IT0005351082 LETRA ITALIANA 14/11/2019	EUR	2.801.008,00	6,5%
IT0005172322 BUONI POLIENNALI DEL TES BONO 0,95% 15/03/2023	EUR	2.273.417,26	5,2%
PTOTEYOE0007 OBRIGACOES DO TESOURO BONO 3,85% 15/04/2021	EUR	869.177,70	2,0%
XS1586146851 SOCIETE GENERALE BONO INDEXADO 01/04/2022	EUR	404.907,62	0,9%
XS1602557495 BANK OF AMERICA BONO INDEXADO 04/05/2023	EUR	403.566,76	0,9%
FR0013260486 RCI BANQUE BONO INDEXADO 14/03/2022	EUR	400.924,87	0,9%
XS1633845158 LLOYDS BANKING GROUP PLC MTN BONO INDEXADO 21/06/2024	EUR	397.213,87	0,9%
XS0454773713 KPN BONO 5,625% 30/09/2024	EUR	374.163,00	0,9%
XS1972548231 VOLKSWAGEN BONO 1,50% 01/10/2024	EUR	313.784,70	0,7%
ES0213469580 EUROPEAN INVESTMENT BANK BONO 8,50% 17/06/2021	EUR	31.860,34	0,1%
<b>FONDOS</b>		<b>20.492.880,28</b>	<b>47,3%</b>
<b>Europa</b>		<b>16.615.513,19</b>	<b>38,3%</b>
LU1481584016 FLOSSBACH BOND OPPORTUNITIES IT	EUR	2.176.708,58	5,0%
LU1832969064 MS EURO CORPORATE BOND ID EUR	EUR	2.089.676,47	4,8%
ES0128522028 RENTA 4 VALOR RELATIVO FI, CLASE I	EUR	2.044.728,26	4,7%
LU1161526816 EDR BOND ALLOCATION-I EUR	EUR	2.016.463,09	4,7%
LU1650487413 ETF LYXOR EUROMTS 1-3 Y INVESTMENT GRADE	EUR	1.957.488,00	4,5%
IE00BWGCDT37 PIMCO GIS INCOME FUND EUR HEDGED	EUR	1.955.933,76	4,5%
LU0658026603 AXA IM FIIS EUR SH DUR HIGH YIELD	EUR	1.625.899,48	3,8%
LU1533169881 JPM EUROPE HY SHORT DUR C	EUR	1.041.186,56	2,4%
FR0010754135 ETF AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD	EUR	985.966,20	2,3%
LU0726357444 PICTET EUR SHORT TERM HIGH YIELD I	EUR	721.462,79	1,7%
<b>Resto</b>		<b>3.877.367,09</b>	<b>8,9%</b>
LU1829331989 THREADNEEDLE 8E CREDIT OPPORTUNITIES FUND	EUR	2.720.953,98	6,3%
LU0992624949 CARMIGNAC SECURITE F	EUR	1.156.413,11	2,7%
<b>RENTA VARIABLE</b>		<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<b>OTROS</b>		<b>774.615,76</b>	<b>1,8%</b>

<b>FONDOS DE CAPITAL RIESGO</b>			<b>774.615,76</b>	<b>1,8%</b>
ES0157100001	ALTAMAR GLOBAL VIII - FCR	EUR	743.936,19	1,7%
ES0108904030	ALTAMAR BUYOUT EUROPA	EUR	19.588,34	0,0%
ES0109933038	ARCANO CAPITAL I FCR	EUR	11.091,23	0,0%
<b>LIQUIDEZ</b>			<b>EUR 5.098.989,65</b>	<b>11,8%</b>

<b>POSICIONES ABIERTAS EN DERIVADOS</b>			<b>867.770,41</b>	<b>2,0%</b>
<b>RENTA FIJA</b>			<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<u>Europa</u>			<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
				0,0%
				0,0%
<u>Estados Unidos</u>			<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
				0,0%
<b>RENTA VARIABLE</b>			<b>867.770,41</b>	<b>2,0%</b>
<u>Europa</u>			<b>184.816,18</b>	<b>0,4%</b>
	SWISS MKT IX FUT Dec19 (Posición larga)	CHF	184.816,18	0,4%
<u>Estados Unidos</u>			<b>682.954,23</b>	<b>1,6%</b>
	S&P500 EMINI FUT Dec19 (Posición larga)	USD	682.954,23	1,6%