

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)		35.566.814,26	80,4%
RENTA FIJA DIRECTA		14.943.482,88	33,8%
España		9.488.545,94	21,4%
XS1169199152 EL CORTE INGLÉS SA BONO 3,875% 19/01/2022	EUR	1.101.612,88	2,5%
XS1886543476 EL CORTE INGLES BONO 3,00% 15/03/2024	EUR	1.043.770,00	2,4%
ES0L02006127 LETRA DEL TESORO LETRA 12/06/2020	EUR	851.700,00	1,9%
ES0L02002142 LETRA DEL TESORO BONO 14/02/2020	EUR	850.663,00	1,9%
XS1687934643 ACCIONA BONO 1,85% 22/09/2020	EUR	710.768,30	1,6%
ES0313040034 BANCA MARCH BONO INDEXADO 02/11/2021	EUR	699.499,15	1,6%
XS1405136364 BANCO SABADELL BONO 5,625% 06/05/2026	EUR	616.915,78	1,4%
XS1562614831 BBVA 3,50% 10/02/2027 BONO 3,50% 10/02/2027	EUR	598.854,25	1,4%
XS1565131213 CAIXABANK BONO INDEXADO 15/02/2027	EUR	543.389,52	1,2%
ES0213307046 BANKIA BONO INDEXADO 15/03/2027	EUR	432.009,61	1,0%
XS1551726810 CELLNEX TELECOM BONO 2,875% 18/04/2025	EUR	336.032,35	0,8%
XS2072841062 PAGARE CIE AUTOMOTIVE BONO 24/01/2020	EUR	299.986,01	0,7%
ES0505199481 PAGARE MAXAM BONO 29/01/2020	EUR	299.938,07	0,7%
ES0505223117 PAGARE GESTAMP AUTOMOCION BONO 05/07/2021	EUR	297.672,99	0,7%
XS2025466413 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 0,625% 15/07/2025	EUR	296.647,78	0,7%
XS1967635621 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 1,50% 27/06/2024	EUR	209.112,89	0,5%
XS2060685232 PAGARE EUSKALTEL LETRA 31/01/2020	EUR	199.968,85	0,5%
ES0343307015 KUTXABANK BONO 0,50% 25/09/2024	EUR	100.004,51	0,2%
Europa		5.454.936,94	12,3%
IT0005172322 BUONI POLIENNALI DEL TES BONO 0,95% 15/03/2023	EUR	2.256.083,68	5,1%
PTOTEYOE0007 OBRIGACOES DO TESOIRO BONO 3,85% 15/04/2021	EUR	867.351,78	2,0%
XS1586146851 SOCIETE GENERALE BONO INDEXADO 01/04/2022	EUR	404.326,87	0,9%
XS1602557495 BANK OF AMERICA BONO INDEXADO 04/05/2023	EUR	403.576,47	0,9%
XS1633845158 LLOYDSBANKINGGROUPLCMTN BONO INDEXADO 21/06/2024	EUR	403.101,96	0,9%
FR0013260486 RCI BANQUE BONO INDEXADO 14/03/2022	EUR	400.117,83	0,9%
XS0454773713 KPN BONO 5,625% 30/09/2024	EUR	376.181,80	0,8%
XS1972548231 VOLKSWAGEN BONO 1,50% 01/10/2024	EUR	312.443,85	0,7%
ES0213469580 EUROPEAN INVESTMENT BANK BONO 8,50% 17/06/2021	EUR	31.752,70	0,1%
FONDOS		20.623.331,38	46,6%
Europa		16.726.112,48	37,8%
LU1481584016 FLOSSBACH BOND OPPORTUNITIES IT	EUR	2.180.712,69	4,9%
LU1832969064 MS EURO CORPORATE BOND ID EUR	EUR	2.131.785,82	4,8%
ES0128522028 RENTA 4 VALOR RELATIVO FI, CLASE I	EUR	2.064.896,66	4,7%
LU1161526816 EDR BOND ALLOCATION-I EUR	EUR	2.020.781,94	4,6%
IE00BWGCDT37 PIMCO GIS INCOME FUND EUR HEDGED	EUR	1.985.648,57	4,5%
LU1650487413 ETF LYXOR EURO GOVERNMENT BOND 1-3Y	EUR	1.949.688,00	4,4%
LU0658026603 AXA IM FIIS EUR SH DUR HIGH YIELD	EUR	1.638.174,12	3,7%
LU1533169881 JPM EUROPE HY SHORT DUR C	EUR	1.045.391,71	2,4%
FR0010754135 ETF AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD	EUR	981.310,20	2,2%
LU0726357444 PICTET EUR SHORT TERM HIGH YIELD I	EUR	727.722,77	1,6%
Resto		3.897.218,90	8,8%
LU1829331989 THREADNEEDLE 8E CREDIT OPPORTUNITIES FUND	EUR	2.740.483,40	6,2%
LU0992624949 CARMIGNAC SECURITE F	EUR	1.156.735,50	2,6%
RENTA VARIABLE		0,00	0,0%
EUROPA		0,00	0,0%

OTROS			1.266.854,05	2,9%
FONDOS DE CAPITAL RIESGO			859.120,47	1,9%
ES0157100001	ALTAMAR GLOBAL VIII - FCR	EUR	828.302,11	1,9%
ES0108904030	ALTAMAR BUYOUT EUROPA	EUR	19.716,99	0,0%
ES0109933038	ARCANO CAPITAL I FCR	EUR	11.101,37	0,0%
INMOBILIARIO			407.733,58	0,9%
	HEALTHCARE ACTIVOS YIELD SOCIMI, S.A.	EUR	407.733,58	0,9%
LIQUIDEZ			6.849.591,34	15,5%

POSICIONES ABIERTAS EN DERIVADOS			879.099,02	2,0%
RENTA FIJA			0,00	0,0%
<u>Europa</u>			0,00	0,0%
				0,0%
				0,0%
<u>Estados Unidos</u>			0,00	0,0%
				0,0%
RENTA VARIABLE			879.099,02	2,0%
<u>Europa</u>			447.480,00	1,0%
	EURO STOXX 50	Mar20 (Posición larga)	EUR	447.480,00
				1,0%
<u>Estados Unidos</u>			431.619,02	1,0%
	S&P500 EMINI FUT	Mar20 (Posición larga)	USD	431.619,02
				1,0%