

## S.E.C.I. I FONDO DE PENSIONES (Nº de Registro DGSFP: F0286).

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	DIVISA	VALOR MERCADO	%
<b>RENTA FIJA (incluye intereses a la fecha)</b>		<b>44.556.616,19</b>	<b>84,6%</b>
<b>RENTA FIJA DIRECTA</b>		<b>29.613.920,08</b>	<b>56,2%</b>
<b>España</b>		<b>9.131.794,46</b>	<b>17,3%</b>
XS1886543476 EL CORTE INGLES BONO 3,00% 15/03/2024	EUR	1.528.759,00	2,9%
XS1169199152 EL CORTE INGLES S.A. BONO 3,875% 19/01/2022	EUR	1.019.302,95	1,9%
XS1687934643 ACCIONA BONO 1,85% 22/09/2020	EUR	1.016.452,14	1,9%
ES0313040034 BANCA MARCH BONO INDEXADO 02/11/2021	EUR	997.976,44	1,9%
XS1562614831 BBVA 3,50% 10/02/2027 BONO 3,50% 10/02/2027	EUR	997.921,42	1,9%
ES0213307046 BANKIA BONO INDEXADO 15/03/2027	EUR	967.049,45	1,8%
XS1565131213 CAIXABANK BONO INDEXADO 15/02/2027	EUR	488.466,64	0,9%
XS1405136364 BANCO SABADELL BONO 5,625% 06/05/2026	EUR	482.818,61	0,9%
XS2025466413 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 0,625% 15/07/2025	EUR	449.069,95	0,9%
XS2110828105 PAGARE CIE AUTOMOTIVE LETRA 27/04/2020	EUR	299.984,25	0,6%
XS1967635621 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 1,50% 27/06/2024	EUR	292.315,18	0,6%
ES0505223117 PAGARE GESTAMP AUTOMOCION BONO 05/07/2021	EUR	291.904,43	0,6%
ES0584696183 PAGARE MASMOVIL LETRA 18/09/2020	EUR	199.784,00	0,4%
XS2113607472 PAGARE EUSKALTEL BONO 30/04/2020	EUR	99.990,00	0,2%
<b>Europa</b>		<b>20.482.125,62</b>	<b>38,9%</b>
IT0005381824 LETRA ITALIANA LETRA 14/08/2020	EUR	4.699.624,00	8,9%
IT0005172322 BUONI POLIENNALI DEL TES BONO 0,95% 15/03/2023	EUR	4.351.871,09	8,3%
PTOTEYOE0007 OBRIGACOES DO TESOURO BONO 3,85% 15/04/2021	EUR	4.102.830,10	7,8%
XS1586146851 SOCIETE GENERALE BONO INDEXADO 01/04/2022	EUR	971.402,17	1,8%
FR0013260486 BANCO RCI BONO INDEXADO 14/03/2022	EUR	967.835,42	1,8%
XS1602557495 BANK OF AMERICA BONO INDEXADO 04/05/2023	EUR	950.332,00	1,8%
XS1633845158 LLOYDSBANKINGGROUPPLCMTN BONO INDEXADO 21/06/2024	EUR	928.436,00	1,8%
XS1729872736 FORD FRN 01/12/2024 BONO INDEXADO 01/12/2024	EUR	845.197,83	1,6%
XS0454773713 KPN BONO 5,625% 30/09/2024	EUR	619.832,50	1,2%
FR0013416146 AUCHAN HOLDING BONO 2,375% 25/04/2025	EUR	573.358,64	1,1%
XS1551726810 CELLNEX TELECOM BONO 2,875% 18/04/2025	EUR	512.988,03	1,0%
XS1972548231 VOLKSWAGEN BONO 1,50% 01/10/2024	EUR	480.714,51	0,9%
FR0013477254 AIR FRANCE-KLM BONO 1,875% 16/01/2025	EUR	477.703,33	0,9%
<b>FONDOS</b>		<b>14.942.696,11</b>	<b>28,4%</b>
<b>Europa</b>		<b>14.942.696,11</b>	<b>28,4%</b>
IE00BD9MMF62 ETF JPM EUR ULTRA-SHORT INCOME UCITS	EUR	4.076.709,00	7,7%
IE00BCRY6557 ETF ISHARES EU ULTRASHORT BOND UCITS	EUR	4.060.640,00	7,7%
LU1650487413 ETF LYXOR EURO GOVERNMENT BOND 1-3Y	EUR	2.818.432,00	5,3%
FR0010754135 ETF AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD	EUR	1.396.475,00	2,7%
LU1481584016 FLOSSBACH BOND OPPORTUNITIES IT	EUR	701.044,25	1,3%
ES0128522028 RENTA 4 VALOR RELATIVO FI, CLASE I	EUR	632.071,83	1,2%
LU1161526816 EDR BOND ALLOCATION-I EUR	EUR	631.325,87	1,2%
IE00BWGCDT37 PIMCO GIS INCOME FUND EUR HEDGED	EUR	625.998,16	1,2%
<b>RENTA VARIABLE</b>		<b>847.445,64</b>	<b>1,6%</b>
<b>EUROPA</b>		<b>847.445,64</b>	<b>1,6%</b>
DE0008404005 ALLIANZ AG-REG ACCION	EUR	434.905,20	0,8%
FR0000120628 AXA SA ACCION	EUR	412.540,44	0,8%
<b>ESTADOS UNIDOS</b>		<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>

<b>OTROS</b>			<b>1.436.663,40</b>	<b>2,7%</b>
<b>FONDOS DE CAPITAL RIESGO</b>			<b>1.028.929,82</b>	<b>2,0%</b>
ES0157100001	ALTAMAR GLOBAL VIII - FCR	EUR	843.940,63	1,6%
ES0177043033	ALTAMAR BUYOUT GLOBAL II	EUR	118.003,12	0,2%
ES0108904030	ALTAMAR BUYOUT EUROPA	EUR	51.683,57	0,1%
ES0109933038	ARCANO CAPITAL I FCR	EUR	15.302,50	0,0%
<b>INMOBILIARIO</b>			<b>407.733,58</b>	<b>0,8%</b>
	HEALTHCARE ACTIVOS YIELD SOCIMI, S.A.	EUR	407.733,58	0,8%
<b>LIQUIDEZ</b>			<b>5.584.507,47</b>	<b>10,6%</b>

<b>POSICIONES ABIERTAS EN DERIVADOS</b>			<b>2.683.446,18</b>	<b>5,1%</b>
<b>RENTA FIJA</b>			<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<u>Europa</u>			<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<b>RENTA VARIABLE</b>			<b>2.683.446,18</b>	<b>5,1%</b>
<u>Europa</u>			<b>1.043.860,00</b>	<b>2,0%</b>
	EURO STOXX 50 Jun20 (Posición larga)	EUR	1.043.860,00	2,0%
<u>Estados Unidos</u>			<b>1.639.586,18</b>	<b>3,1%</b>
	S&P500 EMINI FUT Jun20 (Posición larga)	USD	1.639.586,18	3,1%
<b>DIVISA</b>			<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>
<u>Cobertura</u>			<b>0,00</b>	<b>0,0%</b>