

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	%
RENTA FIJA (incluye intereses a la fecha)		46.838.292,25	82,6%
RENTA FIJA DIRECTA		31.613.755,90	55,8%
España		11.222.660,04	19,8%
XS1886543476 EL CORTE INGLES BONO 3,00% 15/03/2024	EUR	1.794.112,00	3,2%
XS1562614831 BBVA 3,50% 10/02/2027 BONO 3,50% 10/02/2027	EUR	1.189.486,58	2,1%
XS1169199152 EL CORTE INGLES BONO 3,875% 19/01/2022	EUR	1.096.025,75	1,9%
ES0213307046 BANKIA BONO INDEXADO 15/03/2027	EUR	1.069.180,41	1,9%
ES0313040034 BANCA MARCH BONO INDEXADO 02/11/2021	EUR	998.262,31	1,8%
XS1687934643 ACCIONA BONO 1,85% 22/09/2020	EUR	964.174,04	1,7%
XS1542427676 ACCIONA BONO INDEXADO 29/12/2019	EUR	802.956,03	1,4%
XS1405136364 BANCO SABADELL BONO 5,625% 06/05/2026	EUR	597.736,11	1,1%
XS1551726810 CELLNEX TELECOM BONO 2,875% 18/04/2025	EUR	557.710,53	1,0%
XS1565131213 CAIXABANK BONO INDEXADO 15/02/2027	EUR	539.993,56	1,0%
XS2025466413 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 0,625% 15/07/2025	EUR	497.972,45	0,9%
XS1967635621 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS BONO 1,50% 27/06/2024	EUR	315.256,18	0,6%
XS2034655725 PAGARE CIE AUTOMOTIVE 24/10/2019	EUR	299.982,01	0,5%
ES0505199457 PAGARE MAXAM 29/10/2019	EUR	299.935,69	0,5%
XS2060685232 PAGARE EUSKALTEL 31/01/2020	EUR	199.876,39	0,4%
Europa		20.391.095,86	36,0%
IT0005381824 LETRA ITALIANA 14/08/2020	EUR	4.710.199,00	8,3%
IT0005172322 BUONI POLIENNALI DEL TES BONO 0,95% 15/03/2023	EUR	4.443.497,38	7,8%
PTOTEYOE0007 OBRIGACOES DO TESOURO BONO 3,85% 15/04/2021	EUR	4.128.594,10	7,3%
XS1729872736 FORD FRN 01/12/2024 BONO INDEXADO 01/12/2024	EUR	1.100.040,30	1,9%
XS1586146851 SOCIETE GENERALE BONO INDEXADO 01/04/2022	EUR	1.012.269,06	1,8%
XS1602557495 BANK OF AMERICA BONO INDEXADO 04/05/2023	EUR	1.008.916,89	1,8%
FR0013260486 BANCO RCI BONO INDEXADO 14/03/2022	EUR	1.002.312,17	1,8%
XS1633845158 LLOYDS BANKING GROUP PLC MTN BONO INDEXADO 21/06/2024	EUR	993.034,67	1,8%
XS0454773713 KPN BONO 5,625% 30/09/2024	EUR	623.605,00	1,1%
XS1972548231 VOLKSWAGEN BONO 1,50% 01/10/2024	EUR	522.974,51	0,9%
XS0953215349 FIAT CHRYSLER FINANCE EU BONO 6,75% 14/10/2019	EUR	426.652,38	0,8%
GR0002194604 LETRA GRIEGA 28/02/2020	EUR	419.000,40	0,7%
FONDOS		15.224.536,35	26,9%
Europa		15.224.536,35	26,9%
IE00BCRY6557 ETF ISHARES EU ULTRASHORT BOND UCITS	EUR	4.107.380,00	7,2%
IE00BD9MMF62 ETF JPM EUR ULTRA-SHORT INCOME UCITS	EUR	4.106.301,00	7,2%
LU1650487413 ETF LYXOR EUROMTS 1-3 Y INVESTMENT GRADE	EUR	2.848.396,00	5,0%
FR0010754135 ETF AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD	EUR	1.406.103,00	2,5%
LU1481584016 FLOSSBACH BOND OPPORTUNITIES IT	EUR	736.732,13	1,3%
IE00BWGCDT37 PIMCO GIS INCOME FUND EUR HEDGED	EUR	679.429,62	1,2%
ES0128522028 RENTA 4 VALOR RELATIVO FI, CLASE I	EUR	674.760,32	1,2%
LU1161526816 EDR BOND ALLOCATION-I EUR	EUR	665.434,28	1,2%
RENTA VARIABLE		0,00	0,0%
EUROPA		0,00	0,0%
ESTADOS UNIDOS		0,00	0,0%

OTROS			993.760,09	1,8%
FONDOS DE CAPITAL RIESGO			993.760,09	1,8%
ES0157100001	ALTAMAR GLOBAL VIII - FCR	EUR	743.936,19	1,3%
ES0177043033	ALTAMAR BUYOUT GLOBAL II	EUR	169.290,20	0,3%
ES0108904030	ALTAMAR BUYOUT EUROPA	EUR	51.419,28	0,1%
ES0109933038	ARCANO CAPITAL I FCR	EUR	29.114,42	0,1%
LIQUIDEZ		EUR	8.476.881,30	15,0%

POSICIONES ABIERTAS EN DERIVADOS			3.655.897,81	6,5%
RENTA FIJA			0,00	0,0%
<u>Europa</u>			0,00	0,0%
RENTA VARIABLE			3.655.897,81	6,5%
<u>Europa</u>			924.080,88	1,6%
	SWISS MKT IX FUTR Dec19 (Posición larga)	CHF	924.080,88	1,6%
<u>Estados Unidos</u>			2.731.816,93	4,8%
	S&P500 EMINI FUT Dec19 (Posición larga)	USD	2.731.816,93	4,8%
DIVISA			0,00	0,0%
<u>Cobertura</u>			0,00	0,0%