

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJAMURCIA XVI, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
BO.BUONI POLIENNALI DEL 3,75% 010924	1.448.761	1.338.768	5,92%
FI. BLACKSTONE GSO EUROPEAN SENIOR	940.020	1.011.490	4,47%
DEUDA ESTADO ITALIA FRN 151119	1.028.240	1.004.931	4,44%
FIL ARCANO EUROPEAN INCOME - D1	901.651	984.297	4,35%
BO.COMMUNITY OF MADRID 2,214% 310528	891.222	893.257	3,95%
BO.ADIF ALTA VELOCIDAD 1,875% 280125	840.952	844.668	3,74%
FI.SANTALUCIA RENTA FIJA -A-	592.720	706.185	3,12%
BO.COMMUNITY OF MADRID 1,826% 300425	634.260	660.629	2,92%
FII.GEFCARE REAL ESTATE FUND	650.000	650.273	2,88%
FI. MUZINICH SHORT DUR HIGH YIELD FUND	602.573	615.034	2,72%
BO.VIARIO A31 SA 5% 251124	575.978	612.665	2,71%
DEUDA ESTADO PORTUGAL 2,875% 151025	548.015	563.749	2,49%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 0,55% 301119	509.551	534.423	2,36%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 2,75% 311024	490.712	515.734	2,28%
DEUDA ESTADO PORTUGAL 3,85% 150421	489.507	501.440	2,22%
BO.DAIMLER AG 2% 250621	487.743	485.210	2,15%
FIL PRINCIPAL PREF SEC-EUR HEDGD I ACCUM	438.711	479.461	2,12%
DEUDA ESTADO ITALIA 1,5% 010625	489.192	469.047	2,07%
BO.ACCIONA FINANCIACION 0 270120	400.082	403.467	1,78%
BO.CRITERIA CAIXA 1,5% 100523	399.456	399.751	1,77%
BO.EDP FINANCE BV 1,5% 221127	403.855	396.847	1,76%
BO.RCI BANQUE SA FRN 080720	390.527	390.908	1,73%
DEUDA ESTADO PORTUGAL FRN 020822	370.755	366.703	1,62%
BO.FCC AQUALIA SA 1,413% 080322 VTO/C/22	360.079	366.035	1,62%
BO.GOLDMAN SACHS GRO FRN 260922 VTO/C/23	361.228	357.402	1,58%
FCR LYXOR EUROPEAN SENIOR DEBT FUND	389.356	343.746	1,52%
BO.JUNTA COMUN CAST MANCHA 4,875% 180320	327.809	328.073	1,45%
BO.JUNTA ANDALUCIA 5,2% 150719	339.452	315.723	1,40%
BO.COMMUNITY OF MADRID 1,189% 080522	306.993	309.853	1,37%
BO.GOLDMAN SACHS GROUP FRN 291019	300.146	301.929	1,34%

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJAMURCIA XVI, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
BO.CAJA RURAL NAVARRA FRN 5Y 21062022	299.919	298.933	1,32%
BO.FORD MOTOR CREDIT CO FRN 071222	299.862	291.304	1,29%
BO.PLANTA SOLAR PUERTOLLANO 3,75% 311237	279.955	281.278	1,24%
BO.BANCA FARMAFACTORING FRN 050620	267.131	258.769	1,14%
BO.KELLOGG CO 0,8% 171122	225.014	228.478	1,01%
FI.IBERIAN PRIVATE DEBT FUND, FIL EUR	212.078	224.282	0,99%
CED AYT CEC.GLOB 25 FTA 4,50 021219	217.444	218.243	0,97%
BO.CP COMBOIOS PORTUGAL 4,17% 161019	223.000	216.226	0,96%
BO.JUNTA CASTILLA Y LEO 6,505% 010319	242.712	212.890	0,94%
BO.SIDECU SA 6% 180320	201.026	212.576	0,94%
BO.FCA BANK SPA FRN 120219	200.094	200.265	0,89%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1,95% 300426	189.197	190.035	0,84%
BO.WELLS FARGO & COMPAN FRN 260421	120.061	120.963	0,53%
CED TDA A-4 4,125% 100421	113.569	112.130	0,50%
BO.IE2 HOLDCO 2,375% 270823 VTO/C/23	99.380	107.090	0,47%
BO.BRISA CONCESSAO RODO 2% 220323	100.250	105.536	0,47%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1,6% 300425	105.084	105.212	0,47%
BO.CENTRAL BANK OF SAVI 1% 060520	99.366	101.748	0,45%
BO.XUNTA GALICIA 1,374% 100519	100.237	101.384	0,45%
BO.SANTAN CONSUMER FINA 0,875% 240122	99.462	101.187	0,45%
BO.CARREFOUR BANQUE FRN 200320	100.276	100.328	0,44%
BO.POSTNL NV 1% 210824 VTO/C/24	100.394	99.302	0,44%
BO.BANCO BILBAO VIZCAYA 0,75% 110922	99.450	98.965	0,44%
BO.RCI BANQUE SA FRN 041124	91.643	89.910	0,40%
BO.HSBC HOLDINGS PLC 1,5% 150322	85.348	88.398	0,39%
BO.EDP FINANCE BV 2,375% 230323	62.231	65.712	0,29%
BO.JUNTA EXTREMADURA 3,5% 290119	49.711	51.663	0,23%
BO.COMUNIDAD MADRID 4,3% 150926	44.594	47.610	0,21%
BO.JUNTA EXTREMADURA 4,1% 300420	34.848	37.824	0,17%
BO.COMUNIDAD AUT MURCIA 4,725% 051118	23.212	21.987	0,10%

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJAMURCIA XVI, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
DERECHOS COBRO AURIGA	31.788	20.616	0,09%
FI.SANTALUCIA CORTO PLAZO -A-	13.041	13.006	0,06%
FUT DTB EURO BUND RXZ8 10122018	-480.630	-476.370	-2,11%
FUT DTB EURO SCHATZ DUZ8 10122018	-1.454.570	-1.453.075	-6,43%
FUT DTB EURO BOBL OEZ8 10122018	-4.598.650	-4.574.500	-20,23%

Valor coste: Importe satisfecho por la compra del activo.

Valor efectivo: Importe que se obtendría por la venta del activo en la fecha a la que va referido el Informe.

V.Efectivo/Activo Total: es el valor efectivo de cada activo dividido por el Activo del Fondo.

Futuro: El Fondo de Pensiones realiza operaciones de compra venta de activos bajo contratos de futuros que son:

-Parte compradora: Comprar una cuantía predefinida de un activo (subyacente) en un momento futuro (vencimiento) y a un precio determinado (precio de ejercicio).

-Parte vendedora: Vender una cuantía predefinida de un activo (subyacente) en un momento futuro (vencimiento) y a un precio determinado (precio de ejercicio).

El subyacente, el vencimiento y el precio de ejercicio son fijados en el momento de la firma del contrato.

Las compras de futuros van con signo positivo y las ventas van con signo negativo.

El fondo tiene posiciones adicionales en Tesorería y otros activos no financieros como por ejemplo, Administraciones Públicas y Depósitos y fianzas constituidas.

Todos los importes del informe son en euros.