

## POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJA DE AHORROS DE MURCIA, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
FI.SANTALUCIA RETORNO ABSOLUTO FI-A-	8.535.000	8.692.488	8,99%
FUT DTB EUROSTOXX 50 VGZ8 2112218	6.911.730	7.011.090	7,25%
FI.SANTALUCIA CORTO PLAZO -A-	6.055.466	6.076.769	6,29%
DEUDA ESTADO ITALIA 3,75% 010521	2.670.352	2.572.233	2,66%
BO.BUONI POLIENNALI DEL 3,75% 010924	2.529.582	2.337.531	2,42%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 4% 300420	2.316.300	2.167.014	2,24%
FIL ARCANO EUROPEAN INCOME - D1	1.752.088	1.918.676	1,99%
FI. BLACKSTONE GSO EUROPEAN SENIOR	1.700.000	1.863.853	1,93%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1% 301130	1.662.943	1.724.146	1,78%
BO.VIARIO A31 SA 5% 251124	1.323.030	1.400.376	1,45%
BO.OBRIGACOES DO TESOOUR FRN 051222	1.356.030	1.343.648	1,39%
BO.DAIMLER AG 2% 250621	1.335.991	1.329.054	1,38%
FCR ALTAMAR V-PRIV.EQUITY PROGRAM 2010	689.789	1.316.563	1,36%
FI.SANTALUCIA ESPABOLSA -A-	746.698	1.305.922	1,35%
BO.FCE BANK PLC 1,528% 091120	1.285.223	1.288.689	1,33%
BO.FORD MOTOR CREDIT CO FRN 011224	1.281.709	1.252.381	1,30%
BO.WELLS FARGO & COMPAN FRN 260421	1.160.592	1.169.313	1,21%
BO.PURPLE PROTECTED ASS 0 051224	1.012.880	1.131.900	1,17%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 2,15% 311025	1.049.620	1.096.484	1,13%
BO.CRITERIA CAIXA 2,375% 090519	1.047.070	1.022.930	1,06%
BO.ACCIONA FINANCIACION 0 270120	1.000.205	1.008.667	1,04%
BO.SANTANDER INTL DEBT FRN 040320	999.530	1.005.553	1,04%
BO.COMMUNITY OF MADRID 0,997% 300924	969.624	1.002.030	1,04%
FIL ARCANO SECONDARY FUND II FCR	425.232	963.710	1,00%
BO.RCI BANQUE SA FRN 140322	932.139	931.537	0,96%
FI.SANTALUCIA R.VARIABLE ZONA NOEURO -A-	624.000	890.519	0,92%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1,5% 300427	849.798	885.621	0,92%
BO.COMUNIDAD MADRID 4,3% 150926	803.652	881.394	0,91%
FCR LYXOR EUROPEAN SENIOR DEBT FUND	973.390	859.364	0,89%
BO.UNICREDIT SPA VAR 310824	898.137	840.616	0,87%

## POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJA DE AHORROS DE MURCIA, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
FI.SANTALUCIA FONVALOR EURO -A-	536.903	838.754	0,87%
BO.GOLDMAN SACHS GROUP FRN 290419	830.884	834.103	0,86%
BO.FCC AQUALIA SA 1,413% 080322 VTO/C/22	810.178	823.578	0,85%
BO.BANCA MARCH FRN 02112021	799.538	800.164	0,83%
BO.COMMUNITY OF MADRID 300427	703.401	742.137	0,77%
BO.BANKIA SA VAR 220519 VTO/C/24	728.812	723.237	0,75%
BO.CATALUNYA BANC VAR 210321	601.453	641.000	0,66%
BO.COMMUNITY OF MADRID 2,214% 310528	626.203	630.534	0,65%
BO.BCP COVERED 5 YR MS+70	598.158	607.042	0,63%
DEUDA ESTADO ITALIA FRN 151119	620.604	602.959	0,62%
BO.CAJA RURAL NAVARRA FRN 5Y 21062022	599.838	597.866	0,62%
BO. DEUTSCHE BANK AG 0 151021	574.228	567.716	0,59%
FCR ALTAMAR GLOBAL PRIV.EQT.PROGRAM VIII	470.000	561.866	0,58%
BO.KELLOGG CO 0,8% 171122	541.032	549.363	0,57%
BO.SKY PLC FRN 010420	542.322	544.479	0,56%
BO.GOLDMAN SACHS GRO FRN 260922 VTO/C/23	541.841	536.103	0,55%
ACC TELEFONICA SA	855.777	518.243	0,54%
BO.BANCO SABADELL SA 0,875% 050323	499.380	491.175	0,51%
ACC AIRBUS GROUP SE (B.PARIS)	235.082	489.298	0,51%
FI.IBERIAN PRIVATE DEBT FUND, FIL EUR	444.522	470.137	0,49%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 5,5% 300421	503.680	465.882	0,48%
DEUDA ESTADO ITALIA 1,5% 010625	484.983	465.325	0,48%
ACC THALES SA	100.194	452.450	0,47%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 0,55% 301119	418.261	443.571	0,46%
BO.JUNTA COMUN CAST MANCHA 4,875% 180320	402.511	437.431	0,45%
BO.COM. ISLAS BALEARES 4,796% 040320	423.325	437.293	0,45%
BO.COMMUNITY OF MADRID 3,25% 030546	407.471	436.278	0,45%
ACC SAP SE	245.273	435.766	0,45%
ACC SIEMENS AG	299.695	423.154	0,44%
BO.AUTOSTRADA BRESCIA V 2,375% 200320	394.680	414.373	0,43%

## POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJA DE AHORROS DE MURCIA, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
BO.JPMORGAN CHASE & CO FRN 270120	410.369	412.552	0,43%
BO.COMUNIDAD AUTO ARAGO 2,875% 100219	400.306	411.566	0,43%
FII SEGURFONDO INVERSION >EN LIQUIDACION	740.369	409.814	0,42%
FI. ARCANO SPANISH OPP. REAL ESTATE FUND	265.601	406.531	0,42%
BO.GOLDMAN SACHS GROUP FRN 291019	400.568	402.572	0,42%
ACC APPLUS SERVICES SA	243.458	401.674	0,42%
BO.INTESA SANPAOLO SPA FRN 150620	400.296	400.185	0,41%
BO.MAPFRE SA 1,625% 190526	393.660	399.778	0,41%
FIL.ALTAN III GLOBAL	316.183	397.302	0,41%
FCR ALTAMAR GLOBAL SECONDARIES IX FCR	357.232	397.113	0,41%
ACC TELEPERFORMANCE	56.401	396.338	0,41%
BO.BANCO BILBAO VIZCAYA 0,75% 110922	397.800	395.860	0,41%
ACC BAYER AG	410.790	393.414	0,41%
ACC VINCI SA	178.064	390.497	0,40%
ACC AMUNDI - W/I	233.513	390.080	0,40%
ACC ALLIANZ SE	145.161	362.304	0,37%
ACC ACERINOX	235.250	360.138	0,37%
ACC DEUTSCHE POST AG	251.915	355.438	0,37%
ACC ATOS	228.896	354.958	0,37%
ACC ALMIRALL SA	298.335	353.886	0,37%
ACC TOTAL FINA	262.171	346.320	0,36%
ACC CORPORACION MAPFRE	303.397	338.671	0,35%
ACC NATURGY ENERGY GROUP, S.A.	221.439	336.781	0,35%
BO.CREDIT AGRICOLE VAR 141025 VTO/C/49	262.500	333.519	0,35%
FI.MIROVA EUROFIDEME 3	303.146	326.368	0,34%
BO.JUNTA CASTILLA Y LEO 6,505% 010319	364.068	319.335	0,33%
ACC BANCO SANTANDER, S.A	298.629	318.109	0,33%
ACC DAIMLER AG	238.215	317.839	0,33%
BO.XUNTA GALICIA 1,374% 100519	300.711	304.153	0,31%
ACC BANKIA	870.105	303.893	0,31%

## POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJA DE AHORROS DE MURCIA, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
ACC MICHELIN	207.613	283.730	0,29%
ACC SANOFI SA	194.931	277.989	0,29%
ACC BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES	258.842	274.475	0,28%
BO.RCI BANQUE SA FRN 041124	276.944	271.708	0,28%
ACC TALGO SA	390.062	255.627	0,26%
ACC CAPGEMINI	67.509	246.718	0,26%
ACC AMADEUS IT HOLDING	43.025	241.420	0,25%
ACC PEUGEOT CITROEN	163.130	237.550	0,25%
ACC CIE AUTOMOTIVE SA	242.249	232.988	0,24%
BO.COMMUNITY OF MADRID 1,826% 300425	223.568	229.692	0,24%
TIT AYT C.MUR HIP CALL170721 171019 SR.A	223.512	221.372	0,23%
ACC BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	299.295	218.282	0,23%
ACC BNP- PARIBAS	195.322	217.112	0,22%
CED IM CEDULAS 5 3,5% 150620	148.680	214.262	0,22%
BO.IE2 HOLDCO 2,375% 270823 VTO/C/23	198.760	214.179	0,22%
ACC FERROVIAL S.A.	106.599	213.493	0,22%
ACC ROYAL DUTCH SHELL (EUR) A SHS	153.264	210.988	0,22%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1,6% 300425	210.168	210.423	0,22%
BO.AMADEUS CAP MARKT625% 170821 VTO/C/21	201.236	210.399	0,22%
BO.ASSICURAZIONI GENERAL VAR 211125/C/49	169.600	206.004	0,21%
BO.CENTRAL BANK OF SAVI 1% 060520	198.732	203.495	0,21%
ACC POSTNL	261.828	197.351	0,20%
TIT AYT HIPOT.MIXTO1 B FRN 150619 / 0935	207.002	190.528	0,20%
ACC GALP	128.615	182.419	0,19%
ACC AZKO NOBEL NV	111.144	179.765	0,19%
ACC ING GROEP NV -ORD SHS	136.797	178.273	0,18%
BO.CARREFOUR BANQUE FRN 200320	176.486	176.578	0,18%
ACC NOKIA	226.324	171.977	0,18%
ACC MIQUEL Y COSTAS	62.385	165.632	0,17%
FCR ARCANO CAPITAL X	138.000	165.393	0,17%

## POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJA DE AHORROS DE MURCIA, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
ACC RED ELECTRICA CORP.	171.023	159.401	0,16%
BO.JUNTA EXTREMADURA 4,1% 300420	139.394	151.296	0,16%
ACC HEIDELBERGCEMENT AG	100.041	142.853	0,15%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 2,75% 311024	129.768	134.639	0,14%
FCR ALTAMAR VI EMERG MKTS PRIVATE EQTY	91.009	122.522	0,13%
ACC INDITEX SA	143.112	114.884	0,12%
BO.SIDECU SA 6% 180320	100.524	106.288	0,11%
BO.JUNTA EXTREMADURA 3,5% 290119	99.422	103.326	0,11%
TIT FTA BANCAJA 8 A FRN 250121 VTO/C/37	103.580	102.431	0,11%
ACC VIVENDI	70.954	101.938	0,11%
BO.SANTAN CONSUMER FINA 0,875% 240122	99.462	101.187	0,10%
FCR GALDANA VENTURES I FCR	85.000	98.199	0,10%
ACC PROSEGUR SA CIA DE SEGURIDAD NUEVAS	77.691	94.658	0,10%
FCR ALTAMAR INFRASTRUCTURE INCOME FCR	78.266	82.613	0,09%
ACC EURONEXT NV	58.173	82.199	0,09%
ACC DISTRIBUIDORA INT ALIMENTAC (DIA SA)	166.838	76.292	0,08%
ACC TECNICAS REUNIDAS	66.207	73.751	0,08%
FCR ALTAMAR BUYOUT EUROPA	19.184	59.796	0,06%
FCR ALTAMAR SECONDARY OPPORTUNITIES VII	26.684	50.041	0,05%
TIT TDA 14 MBS A3 FRN 271230 VTO/C/30	42.385	42.150	0,04%
TIT AYT HIP.MIXT1A FRN 150619 VTO/C/35	11.068	10.995	0,01%
FUT MEFF RV IBEX 35 IBV8 191018	-564.900	-562.080	-0,58%
FUT DTB EURO BOBL OEZ8 10122018	-5.649.770	-5.620.100	-5,81%

## POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO CAJA DE AHORROS DE MURCIA, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
-------------------------	-------------	----------------	-----------------------------

**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.