

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

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
FI.SANTALUCIA RENTA FIJA -A-	2.059.615	2.090.476	10,74%
BO.COMMUNITY OF MADRID 2,875% 060419	1.917.014	1.842.128	9,47%
DEUDA ESTADO ITALIA 3,75% 010521	1.573.403	1.515.589	7,79%
FI.MUTUAFONDO CORTO PLAZO-A	800.000	797.658	4,10%
BO.CRITERIA CAIXA 1,625% 210422	701.196	714.429	3,67%
DEUDA ESTADO ITALIA VAR 150620	738.430	711.104	3,65%
BO.TELEFONICA EMISIONES 0,318% 171020	703.619	705.104	3,62%
FI. BLACKSTONE GSO EUROPEAN SENIOR	650.000	682.960	3,51%
FIL ARCANO EUROPEAN INCOME - D1	604.534	636.651	3,27%
BO.BBVA VAR 110419 VTO/C/24	619.122	618.194	3,18%
BO.GOLDMAN SACHS GROUP FRN 311218	601.320	600.504	3,09%
BO.BANCO SABADELL SA 0,875% 050323	496.560	491.175	2,52%
BO.DAIMLER AG 2% 250621	466.536	464.114	2,39%
BO.GOLDMAN SACHS GRO FRN 090921 VTO/C/22	452.751	453.962	2,33%
DEUDA ESTADO PORTUGAL FRN 120422	427.480	424.850	2,18%
BO.LEASEPLAN CORPORATIO FRN 041120	409.720	410.561	2,11%
BO.GENERAL MOTORS FINL FRN 100521	401.288	401.287	2,06%
BO.BANCA MARCH FRN 02112021	399.769	400.082	2,06%
BO.VODAFONE GROUP PLC FRN 250219	342.055	343.330	1,76%
BO.GALP ENERGIA SGPS SA 4,125% 250119	319.125	312.101	1,60%
BO.ACCIONA FINANCIACION 0 270120	300.061	302.600	1,56%
BO.AMADEUS CAP MARKT 19/05/2019 MS+30	299.949	300.069	1,54%
BO.CAJA RURAL NAVARRA FRN 5Y 21062022	299.919	298.933	1,54%
BO.FORD MOTOR CREDIT CO FRN 071222	299.862	291.304	1,50%
BO.MOLSON COORS BREWING 150319	280.084	280.096	1,44%
BO.RCI BANQUE SA FRN 180319	277.499	277.056	1,42%
BO.BANCA FARMAFACTORING FRN 050620	267.131	258.769	1,33%
BO.RCI BANQUE SA FRN 140322	258.593	258.426	1,33%
BO.RCI BANQUE SA FRN 080720	256.346	256.596	1,32%
FI.SANTALUCIA CORTO PLAZO -A-	242.676	242.694	1,25%

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

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
BO.FCE BANK PLC FRN 260820	237.415	236.352	1,21%
FI. MUZINICH SHORT DUR HIGH YIELD FUND	220.000	222.992	1,15%
BO.NN GROUP NV 0,25% 010320 VTO/C/20	216.600	216.708	1,11%
BO.OBRIGACOES DO TESOOUR FRN 051222	208.780	206.715	1,06%
BO.SANTAN CONSUMER FINA 0,875% 240122	198.924	202.374	1,04%
BO.PRINCIPADO DE ASTURIAS SPGB+27 310120	198.453	200.947	1,03%
BO.FCE BANK PLC 1,528% 091120	165.835	166.282	0,85%
TIT RAYO-2008-1 A FRN 150421	120.345	122.158	0,63%
PAG TUBACEX 0,7% 18/01/2019	99.323	99.808	0,51%
DERECHOS COBRO AURIGA	52.980	34.359	0,18%
FUT DTB EURO BOBL OEZ8 10122018	-525.560	-522.800	-2,69%
FUT DTB EURO SCHATZ DUZ8 10122018	-1.566.460	-1.564.850	-8,04%

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.