

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO SANTALUCIA F.RF

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
FUT DTB EURO BOBL OEM3 08062023	2.530.000	2.593.360	12,54%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 0% 010426	744.473	678.975	3,28%
BO.BUONI POLIENNALI 0,35% 010225	705.537	665.414	3,22%
CED TDA-6 FONDO 3,875% 230525	612.444	622.586	3,01%
FIL ARCANO EUROPEAN INCOME - D1	477.965	585.089	2,83%
FUT DTB EURO BUND RXM3 08062023	542.350	543.360	2,63%
FII SEGURFONDO INVERSION >EN LIQUIDACION	783.950	500.400	2,42%
BO.COMMUNITY OF MADRID 2,214% 310528	525.937	486.450	2,35%
FI.SANTALUCIA RF CORTO PLAZO -A-	468.258	474.121	2,29%
BO.VOLKSWAGEN FIN SERV AG 0,25% 310125	494.393	470.837	2,28%
BO.ALD SA 1,25% 020326	503.590	462.715	2,24%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 0% 010826	493.210	447.495	2,16%
BO.CAIXA GERAL DEP.5,75% 280623 VTO/C/23	430.592	416.364	2,01%
BO.IBERCAJA BANCO SA VAR 150624 V/C/25	395.608	405.113	1,96%
BO.BANKIA SA 3,75% 150224 VTO/C/29	398.860	395.580	1,91%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1,5% 300427	390.144	382.748	1,85%
BO.SWEDBANK 0,25% 091024	398.324	379.470	1,83%
BO.EUROPEAN BK RECON 0,05% 080122 V/C/36	498.800	364.736	1,76%
BO.NYKREDIT REALKREDIT VAR 280426 V/C/31	399.564	349.415	1,69%
CED AYT CAJAS X 3,75% 300625	303.237	308.709	1,49%
ETF. ISHARES J.P. MORGAN USD EM	313.171	301.697	1,46%
BO.BUONI POLIENNALI 2,1% 150726	324.555	289.779	1,40%
BO.BANK OF AMERICA COR VAR 271025 V/C/26	299.988	287.351	1,39%
BO.REGION BRETAGNE 0% 310126	300.284	275.157	1,33%
BO.MEDIOBANCA DI CRED FIN 1% 080927	301.530	268.530	1,30%
BO.CAIXA GERAL DE DEPO VAR 210926 V/C/27	300.012	261.163	1,26%
BO.UNICAJA BANCO SA VAR 131124 VTO/C/29	300.097	257.589	1,25%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1,3% 311026	249.960	245.293	1,19%
BO.UNICREDIT SPA VAR 030724 VTO/C/25	251.630	244.866	1,18%
BO.UNIONE DI BANCHE 1,625% 210425	249.395	242.086	1,17%

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO SANTALUCIA F.RF

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
FIL.ALTAN III GLOBAL	140.180	219.830	1,06%
BO.INTESA SANPAOLO SPA 4,75% 060927	202.641	208.870	1,01%
BO.UNICAJA BANCO SA 4,5% 300624 V/C/25	201.476	206.160	1,00%
BO.JYSKE BANK A/S VAR 110425 V/C/26	198.068	204.612	0,99%
BO.BELFIUS BANK SA/NV 3,25% 181027	200.826	203.481	0,98%
BO.NATWEST GROUP PLC VAR 060927 V/C/28	197.776	201.619	0,97%
BO.KUTXABANK SA VAR 010227 V/C/28	200.460	201.213	0,97%
BO.BANCO SANTANDER SA 3,25% 140228	198.514	199.925	0,97%
BO.DNB BANK ASA VAR 281127 V/C/33	201.034	199.664	0,97%
BO.CAJAMAR CAJA RURAL SCC 3,375% 160228	197.898	199.259	0,96%
BO.LLOYDS BANKING GR. VAR 070923 V/C/28	207.240	198.674	0,96%
BO.CAJA RURAL DE NAVARRA 3% 260427	198.196	197.642	0,96%
BO.DEUTSCHE BANK AG VAR 050929 V/C/30	196.100	197.233	0,95%
BO.DANSKE MORTGAGE BANK PL 2,125% 160925	198.184	196.674	0,95%
BO.MEDIOBANCA DI CRED FIN 2,375% 300627	201.710	194.426	0,94%
BO.CAIXABANK SA VAR 130425 V/C/26	198.842	192.390	0,93%
BO.KUTXABANK SA 0,50% 25092024	199.838	190.134	0,92%
BO.NATIONWIDE BLDG SOCIETY 2% 280427	198.912	189.499	0,92%
BO.SANTANDER CONSUM 0,25% 151024	199.220	188.949	0,91%
BO.UNICREDIT SPA VAR 230924 V/C/29	202.578	187.579	0,91%
BO.BANCO DE SABADELL SA VAR 301126	200.182	185.200	0,90%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 0,5% 010226	205.256	184.966	0,89%
BO.NATIONWIDE BLDG SOCIETY 0,25% 220725	200.518	184.931	0,89%
BO.WELLS FARGO & COMPANY 1,5% 240527	205.324	184.008	0,89%
BO.SANTANDER UK PLC 1,125% 120327	199.048	183.739	0,89%
BO.SKANDINAVISKA ENSKILDA 0,75% 280627	197.242	181.946	0,88%
BO. BANKIA 1,125% 121126	199.310	181.487	0,88%
BO.NORDEA BANK AB VAR 180526 V/C/31	198.800	176.565	0,85%
BO.CREDIT SUISSE GR VAR 240626 VTO/C/27	203.138	175.116	0,85%
BO.SKANDINAVISKA ENSKILDA 0,75% 090827	196.558	174.460	0,84%

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO SANTALUCIA F.RF

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
BO.BANKINTER SA 0,625% 061027	199.826	172.403	0,83%
BO.ABANCA CORP BANCARI VAR 080926 V/C/27	199.980	171.291	0,83%
FI.IBERIAN PRIVATE DEBT FUND, FIL EUR	149.267	164.765	0,80%
BO.UBS GROUP AG VAR 051127 V/C/28	199.484	164.126	0,79%
BO.BANCO DE CREDITO SO VAR 090327 V/C/28	200.218	160.152	0,77%
TIT FT RMBS PRADO VII VAR 150925 V/C/55	143.794	144.584	0,70%
BO.VIARIO A31 SA 5% 251124	136.411	132.460	0,64%
BO.PLANTA SOLAR PUERTOLLANO 3,75% 311237	150.605	129.361	0,63%
BO.BANCO DE CREDITO SO VAR 220925 V/C/26	100.435	105.631	0,51%
BO.INTESA SANPAOLO 6,625% 130923	120.182	104.476	0,51%
BO.BANCO BILBAO VIZCAYA 3,125% 170727	100.727	99.901	0,48%
BO.CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG 3,39% 051225	100.175	99.446	0,48%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1,95% 300426	105.940	99.232	0,48%
BO.BANCO SABADELL SA 1,75% 100524	99.875	98.275	0,48%
BO.ELECTRICITE FRANCE VAR040724 VTO/C/49	108.192	98.127	0,47%
BO.STADSHYPOTEK AB 2,625% 270929	96.260	98.017	0,47%
BO.MORGAN STANLEY VAR 080525 V/C/26	100.101	97.904	0,47%
BO.unicredit BK AUSTRIA AG 2,375% 200927	98.257	97.671	0,47%
BO.ALD SA 0% 230224	99.946	96.569	0,47%
BO.CAIXA GERAL DEP.1,25% 251124	100.352	96.121	0,46%
BO.BARCLAYS PLC VAR 310126 V/C/27	100.212	95.796	0,46%
BO. DANSKE BANK A/S VAR 120225 VTO/C/30	99.482	92.927	0,45%
BO.SOCIETE GENERALE SFH 1,375% 050528	98.759	92.890	0,45%
BO. BANKINTER SA 0,875% 080726	100.324	90.646	0,44%
BO.BANCO DE SABADELL VAR 110326 V/C/27	100.269	90.516	0,44%
BO.CITIGROUP INC VAR 081026 VTO/C/27	99.970	88.327	0,43%
BO.BNP PARIBAS VAR 141026 V/C/27	100.255	87.894	0,42%
TIT FT RMBS PRADO IX VAR 170926 V/C/55	87.314	86.429	0,42%
BO.NATWEST GROUP PLC VAR 260229 V/C/30	99.820	80.622	0,39%
BO.CREDIT AGRICOLE AS 1,5% 060431 V/C/31	98.688	77.132	0,37%

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO SANTALUCIA F.RF

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V.EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
BO.GOLDEN BAR SECUR FRN 200424 VTO/C/39	38.994	39.181	0,19%

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.

Opciones: El Fondo de Pensiones realiza operaciones de compra y venta de opciones financieras. En el informe figuran el coste de la prima pagada / cobrada y la valoración de esta.

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

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.