

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO FONDO DE PENSIONES DE EMPLEO DE CASTILLA LA MANCHA

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V. EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
FUT DTB EUROSTOXX 50 VGZ3 15122023	811.460	798.760	10,43%
ETF INVESCO S&P 500 UCITS	568.124	559.370	7,31%
BO.BUONI ORDINARI DEL TES 0 120424	485.395	489.685	6,40%
BO.BUONI ORDINARI DEL TES 0 140624	482.160	486.375	6,35%
FUT DTB EURO BUND RXZ3 07122023	389.310	385.920	5,04%
BO.BUONI POLIENNALI 1,75% 010724	287.053	281.648	3,68%
BO.CITIGROUP INC 0,75% 260723 V/C/23	203.917	200.979	2,63%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 0% 150124	197.300	197.796	2,58%
BO.CANAL DE ISABEL II GEST.1,68% 260225	193.108	195.196	2,55%
BO.BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0% 310127	204.330	187.345	2,45%
BO.BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0% 310524	183.605	177.475	2,32%
BO.INTESA SANPAOLO SPA 4,75% 060927	150.452	150.362	1,96%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 3,150% 300433	145.765	143.334	1,87%
ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE U	139.744	137.488	1,80%
BO.BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0% 310525	128.280	127.324	1,66%
BO.BPCE SA VAR 010628 V/C/33	100.197	102.788	1,34%
BO.BANCO SABADELL SA 5,625% 060526	99.533	102.420	1,34%
BO.IBERCAJA BANCO SA VAR 070626 V/C/27	99.811	102.304	1,34%
BO.CAIXABANK SA VAR 301128 V/C/34	99.418	101.461	1,33%
CED TDA-6 FONDO 3,875% 230525	99.542	100.906	1,32%
BO.COOPERATIEVE RABOBA VAR 250428 V/C/29	99.822	100.580	1,31%
BO.KUTXABANK SA VAR 010227 V/C/28	98.294	100.557	1,31%
BO.DNB BANK ASA VAR 281127 V/C/33	98.127	100.463	1,31%
BO.FLOENE ENERGIAS 4,875% 030428 V/C/28	100.061	100.384	1,31%
BO.VOLKSWAGEN LEASING GMBH 4,5% 250326	100.157	100.347	1,31%
BO.BANK OF AMERICA COR VAR 220925 V/C/26	102.030	100.249	1,31%
CED AYT CAJAS X 3,75% 300625	99.186	100.152	1,31%
BO.UNICAJA BANCO SA VAR 110927 V/C/28	99.830	99.839	1,30%
BO.BANCO SANTANDER TOTTA S 3,375% 190428	98.375	99.456	1,30%
BO.ABN AMRO BANK NV 5,5% 210628 V/C/33	99.508	99.241	1,30%
BO.BANCO DE CREDITO SO VAR 140928 V/C/29	99.559	99.089	1,29%
BO.CAJA RURAL DE NAVARRA 3% 260427	97.680	98.427	1,29%
BO.BARCLAYS PLC VAR 090624 V/C/25	96.537	97.683	1,28%
BO.ROYAL BANK OF CANADA 0,125% 230724	99.927	96.913	1,27%
BO.ROYAL BANK OF CANADA 0,125% 230724	96.860	96.889	1,27%
BO.DEUTSCHE BANK AG VAR 050929 V/C/30	96.713	96.675	1,26%
BO.KUTXABANK SA 0,50% 25092024	95.403	96.565	1,26%
BO.JYSKE BANK A/S VAR 151024 V/C/25	94.670	96.184	1,26%
BO.CAIXABANK SA VAR 130425 V/C/26	95.218	96.118	1,26%
BO.UNICAJA BANCO SA VAR 131124 VTO/C/29	91.672	95.411	1,25%
BO.CREDIT AGRICOLE SA VAR 050625 V/C/30	93.464	94.682	1,24%
BO.ALD SA 1,25% 020326	92.426	93.353	1,22%
BO. BANKINTER SA 0,875% 080726	91.058	91.373	1,19%
BO.CREDIT SUISSE GR VAR 240626 VTO/C/27	88.790	90.471	1,18%
BO.BANCO DE SABADELL VAR 150126 V/C/31	89.712	90.286	1,18%
BO.NORDEA BANK AB VAR 180526 V/C/31	87.421	88.683	1,16%

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO FONDO DE PENSIONES DE EMPLEO DE CASTILLA LA MANCHA

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V. EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
BO.NYKREDIT REALKREDIT VAR 280426 V/C/31	86.320	87.624	1,14%
BO.ABANCA CORP BANCARI VAR 080926 V/C/27	86.906	86.968	1,14%
BO.BANCO DE CREDITO SO VAR 090327 V/C/28	82.953	83.638	1,09%
BO.NESTLE FINANCE INTL 0% 120824 V/C/24	49.938	48.060	0,63%
ACC INDITEX SA	32.698	39.490	0,52%
ACC LOREAL	29.517	36.568	0,48%
ACC.ADYEN NV	39.682	35.991	0,47%
ACC DASSAULT SYSTEMES SA	33.164	33.389	0,44%
ACC ASML HOLDING NV	25.377	32.987	0,43%
ACC INFINEON TECHNOLOGIES	38.121	32.264	0,42%
ACC AMADEUS IT HOLDING	37.876	31.561	0,41%
BO.NATIONAL AUSTRALIA BANK 0,625% 101123	30.160	30.092	0,39%
ACC LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	36.364	30.089	0,39%
BO.NATIONAL AUSTRALIA BANK 0,625% 101123	29.900	29.926	0,39%
BO.CAISSE DAMORT DETTE SO 1,375% 251124	27.213	26.580	0,35%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 0 061023	21.571	21.995	0,29%
DEUDA ESTADO ESPAÑA 1,8% 301124	11.390	12.556	0,16%

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.

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

Futuros: El Fondo de Pensiones realiza operaciones de compraventa 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.