

POSICIONES DE INVERSIÓN DEL FONDO FUTURESPAÑA, F.P.

CARTERA (NOMBRE ACTIVO)	VALOR COSTE	VALOR EFECTIVO	V. EFECTIVO/ ACTIVO TOTAL
ETF VANGUARD EUR CORPORATE BOND UCITS ET	158.385	162.624	17,11%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 4,2% 010334	74.180	76.076	8,00%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 3,8% 010828	72.816	74.731	7,86%
ETF XTRACKERS II EUR CORPORATE BON	62.811	67.468	7,10%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 3,45% 010236	64.185	66.400	6,99%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 0,9% 010431	54.390	60.166	6,33%
ETF AMUNDI INDEX EURO AGG CORPORATE SRI	49.043	50.816	5,35%
ETF XTRACKERS STOXX EUROPE 600 UCITS ETF	23.265	41.165	4,33%
ETF ISHARES STOXX EUROPE 600 DE	26.440	40.730	4,28%
ETF SS SPDR S&P 500 UCITS EUR HEDGED	28.286	40.386	4,25%
ETF XTRACKERS II EUR HIGH YIELD CORPORAT	30.448	34.115	3,59%
FI NORDEA 1 SICAV - EUROPEAN COVE	30.599	32.868	3,46%
BO.BUONI POLIENNALI DEL TES 1,1% 010427	25.546	27.779	2,92%
ETF AMUNDI MSCI EMERGING MARKET	18.034	26.408	2,78%
PAR SANTALUCIA RETORNO ABSOLUTO -A-	18.663	18.752	1,97%
ETF LYXOR UCITS S&P 500-D-EUR	11.074	18.023	1,90%
ETF AMUNDI GLOBAL AGGREGATE GREEN BOND U	18.578	17.728	1,87%
ETF INVESCO S&P 500 UCITS	14.207	17.322	1,82%
PAR SANTALUCIA R.VARIABLE INT.-A-	11.738	13.139	1,38%
ETF ISHARES EXPANDED TECH-SOFTWARE SECTO	10.667	11.581	1,22%
ETF STATE STREET UTILITIES SELECT SECTOR	9.734	9.845	1,04%
ETF AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS	4.828	6.734	0,71%

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.