

DADES PRINCIPALS

| | |
|----------------------------------|---|
| Nom del Pla: | Cyclops, Plan de Pensiones |
| Nom del Fons: | Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones |
| Categoria: | RENDA FIXA MIXTA |
| Asset Allocation: | 70% Renda Fixa Mixta i menys del 30% Renda Variable |
| Data d'inici: | 23/10/2002 |
| Valor de la participació: | 2.757,21 € (31/12/2021) |
| Principal divisa: | EUR |
| Grau de risc: | Mitjà |
| Duració: | 3,64 |
| Volatilitat: | 1,98% |
| Patrimoni: | 30.840,11 € (31/12/2021) |
| Patrimoni anterior informe: | 30.701,46 € (30/06/2021) |
| Participacions: | 11,19 (31/12/2021) |
| Participacions anterior informe: | 11,19 (30/06/2021) |

POLÍTICA D'INVERSIÓ

El Pla de Pensions inverteix en un fons de pensions amb vocació de renda fixa mixta (amb fins a un 30% de la inversió en valors de renda variable). La inversió és global, invertint majoritàriament en deute públic i bons corporatius europeus amb una qualificació creditícia adequada. El Fons de Pensions inverteix en companyies amb un nivell de risc d'insolència molt baix. L'elecció dels valors es realitza després d'un detallat anàlisi de l'evolució dels resultats i altres paràmetres de les companyies, així com de la situació macroeconòmica del país. El termini mínim per invertir en aquest Fons de Pensions està al voltant dels 5 anys de durada ja que les inversions comporten per a l'inversor un risc elevat a curt termini.

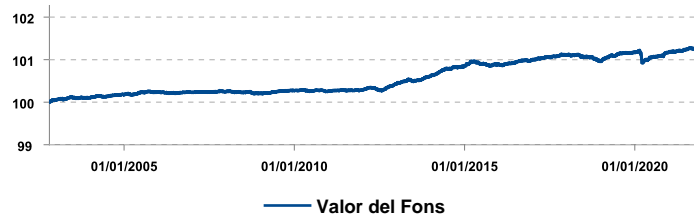
DADES GENERALS DEL PLA

| | |
|---|--------------------------------------|
| Gestora: | MEDIOLANUM PENSIONES, S.A., S.G.F.P. |
| Dipositari: | BANCO MEDIOLANUM, S.A. |
| Promotor: | BANCO MEDIOLANUM, S.A. |
| Entitat encarregada de la gestió del patrimoni: | TREA ASSET MANAGEMENT SGIIC, S.A. |

HISTÓRIC

| | |
|------------|------------|
| 31/12/2021 | € 2.757,21 |
| 30/11/2021 | € 2.743,40 |
| 31/10/2021 | € 2.754,65 |
| 30/09/2021 | € 2.757,88 |
| 31/08/2021 | € 2.770,56 |
| 31/07/2021 | € 2.767,87 |
| 30/06/2021 | € 2.747,58 |
| 31/05/2021 | € 2.726,16 |
| 30/04/2021 | € 2.725,89 |
| 31/03/2021 | € 2.719,04 |
| 28/02/2021 | € 2.696,70 |
| 31/01/2021 | € 2.696,04 |

Evolució Valor Liquidatiu de la Unitat de Compte



Rendibilitat mitjana anual (T.A.E.)

| 2021* | 2020 | 3 anys | 5 anys | 10 anys | 15 anys | 20 anys |
|-------|-------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2,27% | 0,23% | 0,70% | 1,90% | 3,48% | 2,36% | 1,67% |

Rendibilitat últims 5 anys

| 2021* | 2020 | 2019 | 2018** | 2017 |
|-------|-------|-------|--------|-------|
| 2,27% | 0,23% | 6,90% | -4,70% | 3,66% |

* Rendibilitat acumulada fins a l'últim mes natural finalitzat

** En aquests anys es van produir modificacions significatives en la política d'inversió

Rendibilitats pasades no són garantia de rendibilitats futures.

Volatilitat

Últims 12 mesos



Règim d'aportacions i contingències generals cobertes

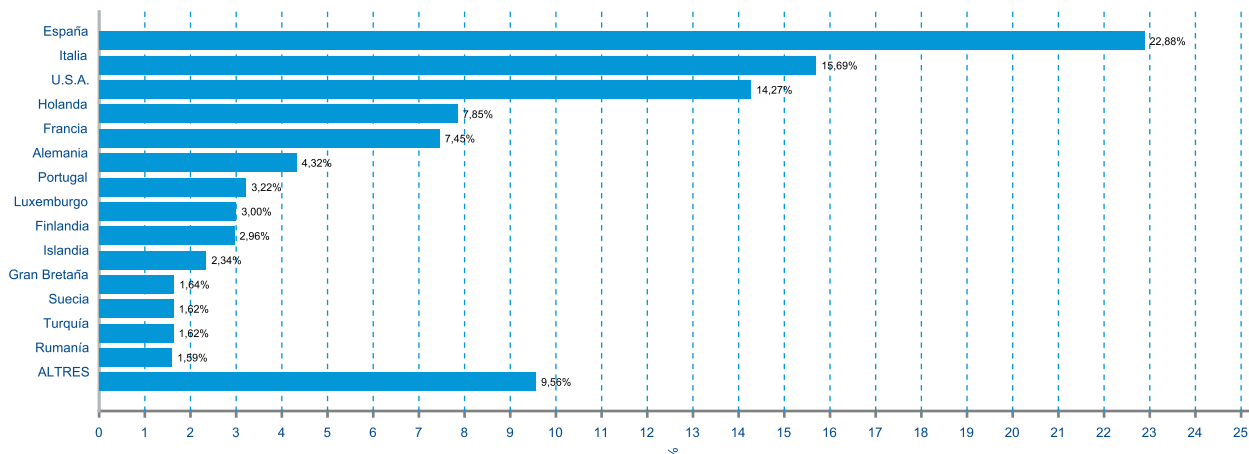
| | |
|-------------------------------------|--|
| Aportació mínima: | 10 Euros/any. |
| Aportació màxima: | Segons el màxim legal establert |
| Contingències cobertes per el Fons: | -Jubilació. -Incapacitat -Mort -Dependència |

Despeses des d'inici d'any

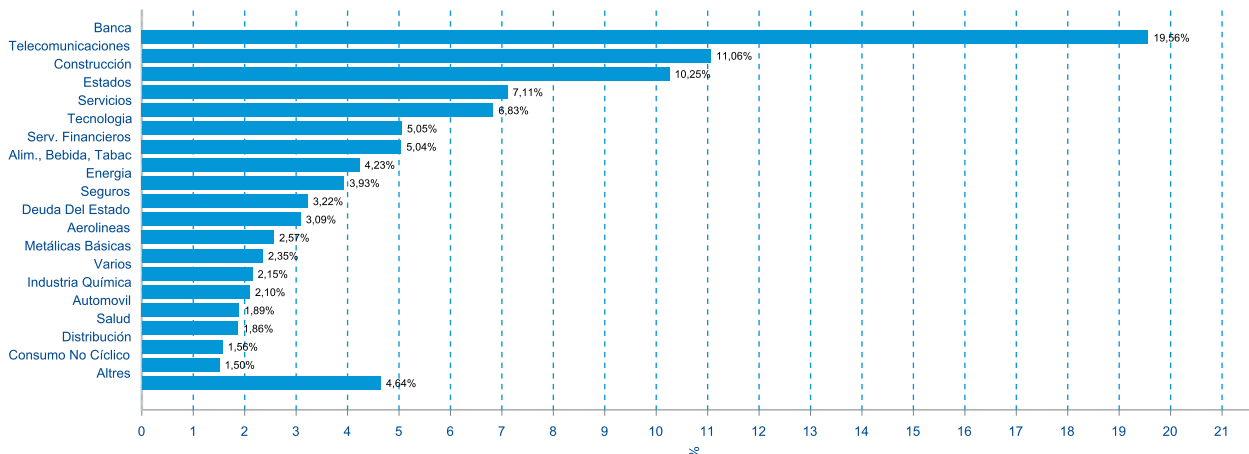
| | Import | % Compte Posició |
|----------------------|----------|------------------|
| Despeses: | 427,73 € | 1,40% |
| Comissió de gestió: | 369,88 € | 1,21% |
| Comissió Dipositari: | 56,91 € | 0,19% |
| Serveis externs: | 0,88 € | 0,00% |
| Notaris: | 0,00 € | 0,00% |
| Assessors: | 0,06 € | 0,00% |
| Altres Despeses: | 0,00 € | 0,00% |

Modificacions estatutàries i reglamentàries

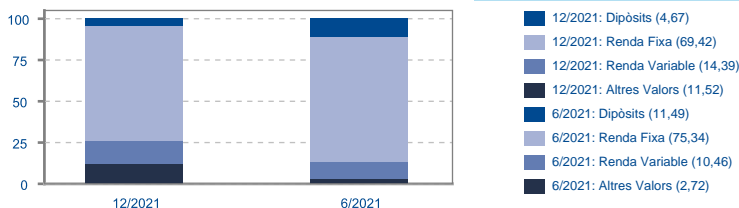
COMPOSICIÓ GEOGRÀFICA SOBRE CARTERA



COMPOSICIÓ SECTORIAL SOBRE CARTERA



Composició de la cartera (%)



Evolució del Mercats Financers

El creixement global ha anat perdent impuls durant la segona part de l'any i ha assolit nivells més sostenibles a mitjà termini. Els problemes a les cadenes de subministrament es van incrementar a mesura que avançava l'any, sense ser l'oferta capaç de cobrir els increments de demanda, reflectint-se en els augments de les matèries primeres i en els costos dels nòlits. A aquests efectes, se li va suman una escalada en els preus de l'energia que van provocar pujades en els preus industrials a nivells històrics, traslladant-se en els últims mesos als preus del consum.

En aquest entorn els actius pertanyents a economies emergents han estat els que han comportat pitjor comportament durant el semestre, sent més sensibles a la retirada d'estímul monetari als EUA. Gran part d'aquest llast a la renda variable ha vingut pel costat de la Xina, on els problemes al seu sector immobiliari i les noves direccions del govern a l'hora de gestionar la seva economia han provocat fortes correccions (Hang Seng -18,8%, CSI 300 -5,4%). Als EUA i Europa els mercats de renda variable van registrar avenços (Nasdaq +12,9%, Eurostoxx 600 +7,9%). Les noves variants de Covid van afectar més el mercat europeu a causa de la seva composició sectorial.

Quant a la renda fixa, les pujades d'inflació han provocat augments de tipus d'interès a tots els països emergents. Els missatges de la Fed anunciant retirada d'estímul i deixant la porta oberta a pujades de tipus d'interès a partir del segon trimestre de l'any, van augmentar la volatilitat en els terminis més curts de la corba en començar a descomptar pujades de tipus d'interès. Els terminis llargs s'han mostrat relativament estables.

En els propers mesos esperem continuar veient episodis de volatilitat com els viscuts durant l'últim trimestre de l'any, provocats en gran mesura per la incertesa sobre com afectarà a l'economia les retirades d'estímul per part dels bancs centrals i com repuntaran els tipus reals als països desenvolupats.

Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composició de la Cartera a data 31/12/2021

(expressat en euros)

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|---|--------|--------------|-------------------|
| CARTERA DE VALORS | | | |
| B. ACCIONA FINANCIACION FIL 1,20 01/25 | Euro | 100.682,84 | 0,08% |
| B. ACS SERVICIOS 1,875 04/26 | Euro | 532.015,34 | 0,44% |
| B. ADLER REAL ESTATE AG 1,5 4/22 | Euro | 397.845,53 | 0,33% |
| B. ARCELORMITTAL 1 05/23 | Euro | 407.191,67 | 0,34% |
| B. ARION BANKI HF 0,375 07/25 | Euro | 396.102,74 | 0,33% |
| B. ARION BANKI HF 0,625 05/24 | Euro | 403.208,00 | 0,33% |
| B. ARION BANKI HF 1 03/23 | Euro | 305.799,90 | 0,25% |
| B. BANCO BPM SPA 0,875 07/26 | Euro | 294.070,60 | 0,24% |
| B. BANCO BPM SPA 1,625 02/25 | Euro | 760.712,26 | 0,63% |
| B. BANCO BPM SPA 1,75 01/25 | Euro | 259.318,87 | 0,21% |
| B. BANCO DE SABADELL 0,7 03/22 | Euro | 145.317,08 | 0,12% |
| B. BANCO DE SABADELL 1,75 05/24 | Euro | 724.965,55 | 0,60% |
| B. BANCO ESPIRITO SANTO 6,875 07/49 | Euro | 26.407,50 | 0,02% |
| B. BERRY GLOBAL INC 1 01/25 | Euro | 101.480,96 | 0,08% |
| B. BPER BANCA 1,875 07/25 | Euro | 206.072,77 | 0,17% |
| B. CAIXA GERAL DE DEPOSITOS 1,25 11/24 | Euro | 204.747,42 | 0,17% |
| B. CAIXABANK SA 0,625 10/24 | Euro | 709.635,74 | 0,59% |
| B. CELLNEX FINANCE CO SA 0,75 11/26 | Euro | 98.347,58 | 0,08% |
| B. CEPSA FINANCE SA 0,75 02/28 | Euro | 687.733,89 | 0,57% |
| B. CIE DE PHALSBOURG 5 03/24 | Euro | 414.948,47 | 0,34% |
| B. CRL CREDITO AGRIC MUT 2,5 VAR 11/26 | Euro | 298.813,23 | 0,25% |
| B. CTP BV 2,125 10/25 | Euro | 422.070,47 | 0,35% |
| B. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 1,625 11/23 | Euro | 200.431,59 | 0,17% |
| B. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2 07/24 | Euro | 402.203,95 | 0,33% |
| B. EL CORTE INGLES SA 3,625 03/24 | Euro | 206.603,57 | 0,17% |
| B. ESPIRITO SANTO 5,25 06/15 | Euro | 1.950,00 | 0,00% |
| B. FCC AQUALIA SA 1,413 06/22 | Euro | 909.579,11 | 0,75% |
| B. FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 3,375 07/23 | Euro | 105.917,89 | 0,09% |
| B. FIN IMMOBILIERE BORDELAI 6,00 01/25 | Euro | 508.454,94 | 0,42% |
| B. HEIMSTADEN AB 4,25 03/26 | Euro | 510.471,11 | 0,42% |
| B. ILIAD SA 0,75 02/24 | Euro | 300.410,26 | 0,25% |
| B. IMMOBILIARE GRANDE DIST 2,125 11/24 | Euro | 2.036.038,90 | 1,69% |
| B. INTL CONSOLIDATED AIRLIN 2,75 03/25 | Euro | 801.485,26 | 0,66% |
| B. LANDSBANKINN HF 0,375 05/25 | Euro | 199.036,22 | 0,16% |
| B. LANDSBANKINN HF 0,50 05/24 | Euro | 502.467,95 | 0,42% |
| B. LAR ESPANA REAL ESTATE 1,75 07/26 | Euro | 718.721,55 | 0,60% |
| B. LOUIS DREYFUS CO BV 2,375 11/25 | Euro | 427.298,96 | 0,35% |
| B. MCC SPA 1,5 10/24 | Euro | 203.989,12 | 0,17% |
| B. MEDIOBANCA DI CRED FIN ESC 01/24 | Euro | 332.898,52 | 0,28% |
| B. MOTA ENGL SGPS SA 4,375 10/24 | Euro | 202.172,64 | 0,17% |
| B. NEINOR HOMES SLU 4,5 10/26 | Euro | 512.525,00 | 0,42% |
| B. NH HOTEL GROUP SA 4 07/26 | Euro | 406.629,26 | 0,34% |
| B. NOKIA OYJ 2,375 05/25 | Euro | 106.713,08 | 0,09% |
| B. NOS SGPS 1,125 05/23 | Euro | 509.785,27 | 0,42% |
| B. ONTEX GROUP NV 3,5 07/26 | Euro | 194.493,70 | 0,16% |
| B. PCF GMBH 4,75 04/26 | Euro | 731.442,44 | 0,61% |
| B. POSCO 0,5 01/24 | Euro | 303.186,25 | 0,25% |
| B. PPF TELECOM GROUP BV 3,5 05/24 | Euro | 864.424,99 | 0,72% |
| B. RCS & RDS SA 2,50 02/25 | Euro | 199.011,78 | 0,16% |
| B. REP. MACEDONIA 5,625 07/23 | Euro | 327.856,03 | 0,27% |
| B. SA DE OBRAS SERVICIOS 6 07/22 | Euro | 411.898,30 | 0,34% |
| B. SERVICIOS MEDIO AMBIENTE 1,661 12/26 | Euro | 210.558,84 | 0,17% |
| B. SIG COMBIBLOC PURCHASER 2,125 06/25 | Euro | 315.269,81 | 0,26% |
| B. TELECOM ITALIA SPA 4 04/24 | Euro | 107.865,11 | 0,09% |
| B. UNIONE DI BANCHE ITALIA 2,625 04/24 | Euro | 536.591,99 | 0,44% |
| B. UNIONE DI BANCHE ITALIAN 1,75 04/23 | Euro | 207.031,51 | 0,17% |
| B. VIA CELERE DESARROLLOS 5,25 04/26 | Euro | 104.385,50 | 0,09% |

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|--|--------|--------------|-------------------|
| O. JUNTA DE CASTILLA Y LEON 0,425 04/30 | Euro | 99.591,53 | 0,08% |
| O. KINGDOM OF MOROCCO 1,5 11/31 | Euro | 92.317,84 | 0,08% |
| O. LANDSBANKIN HF 1 05/23 | Euro | 712.087,47 | 0,59% |
| O. LEONARDO SPA 1,5 06/24 | Euro | 205.391,59 | 0,17% |
| O. LEONARDO SPA 2,375 01/26 | Euro | 212.782,90 | 0,18% |
| O. LEONARDO SPA 4,875 03/25 | Euro | 349.160,38 | 0,29% |
| O. MEDIOBANCA DI CRED FIN 0,75 VAR 11/28 | Euro | 246.385,07 | 0,20% |
| O. MEDIOBANCA DI CRED FIN 1,125 07/25 | Euro | 411.915,89 | 0,34% |
| O. MERCIALYS SA 4,625 07/27 | Euro | 718.268,88 | 0,60% |
| O. MERLIN PROPERTIES 2,375 05/22 | Euro | 407.212,11 | 0,34% |
| O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,375 06/30 | Euro | 298.701,49 | 0,25% |
| O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,875 12/34 | Euro | 394.839,34 | 0,33% |
| O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 2,375 07/27 | Euro | 544.835,89 | 0,45% |
| O. MOTA ENGL SGPS 4 01/23 | Euro | 306.933,33 | 0,25% |
| O. MUTUELLE ASSURANCE 0,625 06/27 | Euro | 98.401,19 | 0,08% |
| O. NE PROPERTY BV 1,75 11/24 | Euro | 205.999,97 | 0,17% |
| O. NE PROPERTY BV 1,875 10/26 | Euro | 618.141,04 | 0,51% |
| O. NE PROPERTY BV 3,375 07/27 | Euro | 224.462,33 | 0,19% |
| O. NEMAK SAB DE CV 2,25 07/28 | Euro | 586.482,74 | 0,49% |
| O. NESTLE FINANCE INTL LTD 0 03/33 | Euro | 185.654,00 | 0,15% |
| O. NESTLE FINANCE INTL LTD 0,375 12/40 | Euro | 363.211,18 | 0,30% |
| O. NEW AREVA HOLDING 4,875 09/24 | Euro | 505.771,27 | 0,42% |
| O. NN GROUP NV VAR 04/44 (CALL4/24) | Euro | 787.377,23 | 0,65% |
| O. NOKIA OYJ 2 03/24 | Euro | 209.836,00 | 0,17% |
| O. NOKIA OYJ 2 03/26 | Euro | 126.367,19 | 0,10% |
| O. NORTEGAS ENERGIA DISTRI 0,905 01/31 | Euro | 196.907,86 | 0,16% |
| O. NORTH MACEDONIA 1,625 03/28 | Euro | 190.744,52 | 0,16% |
| O. NORTH MACEDONIA 2,75 01/25 | Euro | 210.453,84 | 0,17% |
| O. ORANO SA 2,75 03/28 | Euro | 638.638,44 | 0,53% |
| O. ORANO SA 3,375 04/26 | Euro | 219.582,77 | 0,18% |
| O. PARPUBLICA FRN 10/27 | Euro | 197.138,00 | 0,16% |
| O. POSTE ITALIANE SPA VAR 06/49 | Euro | 195.457,26 | 0,16% |
| O. PPF TELECOM GROUP BV 2,125 01/25 | Euro | 626.156,05 | 0,52% |
| O. RAIFFEISEN BANK INTL VAR 06/49 | Euro | 208.712,12 | 0,17% |
| O. RAIFFEISEN LB NIEDEROEST 5,875 11/23 | Euro | 552.796,78 | 0,46% |
| O. RENAULT SA 1 04/24 | Euro | 302.315,55 | 0,25% |
| O. ROADSTER FIN DAC 1,625 12/24 | Euro | 308.569,19 | 0,26% |
| O. ROMANIA 2,124 07/31 | Euro | 96.587,44 | 0,08% |
| O. ROMANIA 2,75 02/26 | Euro | 439.928,33 | 0,36% |
| O. ROMANIA 2,875 03/29 | Euro | 326.809,52 | 0,27% |
| O. ROMANIA 2,875 05/28 | Euro | 329.174,63 | 0,27% |
| O. ROMANIA 3,375 02/38 | Euro | 103.673,63 | 0,09% |
| O. SAIPEN FINANCE INTL BV 3,125 03/28 | Euro | 202.898,03 | 0,17% |
| O. SAIPEN FINANCE INTL BV 3,75 09/23 | Euro | 418.558,03 | 0,35% |
| O. SECURITAS AB 0,25 02/28 | Euro | 96.810,38 | 0,08% |
| O. SIGMA ALIMENTOS 2,625 02/24 | Euro | 212.645,81 | 0,18% |
| O. SUMMIT PROP 2,00 01/25 | Euro | 297.023,67 | 0,25% |
| O. TELECOM ITALIA SPA 1,625 01/29 | Euro | 93.572,32 | 0,08% |
| O. TELEFONAKTIEBOLAGET LM 1 05/29 | Euro | 98.291,74 | 0,08% |
| O. TELEFONICA EUROPE BV 2,625 VAR 06/49 | Euro | 103.705,89 | 0,09% |
| O. TELEFONICA EUROPE BV VAR 03/49 | Euro | 685.910,79 | 0,57% |
| O. TELEFONICA EUROPE VAR 03/49 | Euro | 222.449,97 | 0,18% |
| O. TEOLLISUUJEN VOIMA 2 05/24 | Euro | 522.665,55 | 0,43% |
| O. TEOLLISUUJEN VOIMA OYJ 1,125 03/26 | Euro | 906.331,44 | 0,75% |
| O. TEOLLISUUJEN VOIMA OYJ 1,375 06/28 | Euro | 893.675,59 | 0,74% |
| O. UNIBAIL-RODAMCO-WESTFLD VAR 10/49 | Euro | 1.094.927,79 | 0,91% |
| O. UNICAJA BANCO SA 4,875 VAR 11/48 | Euro | 199.915,76 | 0,17% |
| O. UNICREDIT SPA 0,85 01/31 | Euro | 391.648,33 | 0,32% |

El Fons de Pensiones en el qual està integrat el Pla, ha realitzat determinades operacions catalogades com vinculades per l'article 85 ter del RD 304/204 pel qual s'aprova el Reglament de Plans y Fons de Pensiones. Referent a això, el departament de Control Intern de la gestora ha verificat que les operacions s'han realitzat en interès exclusiu del Fons i a preus i condicions iguals o millors que els de mercat, de conformitat amb el que estableix el Reglament Intern de Conducta i en la Política d'operacions vinculades de Mediolanum Pensiones, S.G.F.P., S.A.

Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composició de la Cartera a data 31/12/2021

(expressat en euros)

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|---|--------|--------------|-------------------|
| B. ZF FINANCE GMBH 3 09/25 | Euro | 316.738,07 | 0,26% |
| O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 01/49 | Euro | 210.012,43 | 0,17% |
| O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 01/29 | Euro | 457.206,90 | 0,38% |
| O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 04/30 | Euro | 220.177,12 | 0,18% |
| O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 09/27 | Euro | 196.669,07 | 0,16% |
| O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 10/48 | Euro | 218.873,24 | 0,18% |
| O. ABERTIS INFRASTRUCTURAS 2,25 03/29 | Euro | 219.873,40 | 0,18% |
| O. AEDIFICA SA 0,75 09/31 | Euro | 192.086,49 | 0,16% |
| O. ARCELORMITTAL 0,95 01/23 | Euro | 406.945,42 | 0,34% |
| O. ARCELORMITTAL 1,75 11/25 | Euro | 421.380,66 | 0,35% |
| O. AROUNDTOWN SA VAR 07/49 | Euro | 96.532,85 | 0,08% |
| O. ASSICURAZIONI GEN VAR 10/47-CALL 10/27 | Euro | 245.315,04 | 0,20% |
| O. ASSICURAZIONI GENERALI VAR 06/48 | Euro | 368.368,85 | 0,31% |
| O. ASTURIANA DE LAMINADOS 5,75 08/27 | Euro | 196.508,37 | 0,16% |
| O. ATRADIUS VAR 09/44 (CALL 9/24) | Euro | 896.602,85 | 0,74% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 4,75 06/26 | Euro | 416.156,66 | 0,34% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 1,875 11/25 | Euro | 103.658,95 | 0,09% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 2 01/30 | Euro | 105.328,29 | 0,09% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 2 12/28 | Euro | 207.874,85 | 0,17% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 5,875 09/25 | Euro | 228.417,07 | 0,19% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 5,875 06/24 | Euro | 347.462,26 | 0,29% |
| O. BANCO COMERC PORTUGUES VAR 02/27 | Euro | 288.964,64 | 0,24% |
| O. BANCO COMERC PORTUGUES VAR 04/28 | Euro | 289.515,99 | 0,24% |
| O. BANCO DE SABADELL SA 1,125 03/25 | Euro | 609.354,08 | 0,50% |
| O. BANCO DE SABADELL SA VAR 06/28 | Euro | 193.982,11 | 0,16% |
| O. BANKIA SA 1,125 11/26 | Euro | 819.968,88 | 0,68% |
| O. BANKIA SA VAR 6,375 PERP 09/49 | Euro | 216.524,42 | 0,18% |
| O. BANKINTER SA 0,625 10/27 | Euro | 299.879,92 | 0,25% |
| O. BANKINTER SA 0,875 07/26 | Euro | 305.904,95 | 0,25% |
| O. BASQUE GOVERNMENT 0,25 04/31 | Euro | 293.179,48 | 0,24% |
| O. BCO COM PORTUGUES VAR 12/27 | Euro | 203.776,44 | 0,17% |
| O. BCOMPOR VAR 03/30 | Euro | 204.563,07 | 0,17% |
| O. BESPL SA 7,125 11/23 | Euro | 1.017,00 | 0,00% |
| O. BEVCO LUX SARL 1,5 09/27 | Euro | 104.935,73 | 0,09% |
| O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0,1 04/31 | Euro | 1.062.461,37 | 0,88% |
| O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0,5 10/31 | Euro | 397.947,73 | 0,33% |
| O. BP CAPITAL MARKETS PLC VAR 06/49 | Euro | 754.995,45 | 0,63% |
| O. BPER BANCA VAR 03/27 | Euro | 297.500,18 | 0,25% |
| O. BULGARIAN ENERGY HLD 2,45 07/28 | Euro | 696.948,77 | 0,58% |
| O. BULGARIAN ENERGY HLD 3,5 06/25 | Euro | 755.112,05 | 0,63% |
| O. BUONI POLIENNALI DEL TES 0,9 04/31 | Euro | 98.633,85 | 0,08% |
| O. BUONI POLIENNALI DEL TES 1,65 12/30 | Euro | 1.790.720,84 | 1,48% |
| O. BUONI POLIENNALI DEL TES 6,5 11/27 | Euro | 135.072,30 | 0,11% |
| O. BUONI POLIENNALI DEL TES ESC 07/30 | Euro | 509.813,85 | 0,42% |
| O. CAIXABANK SA VAR 02/29 | Euro | 196.861,15 | 0,16% |
| O. CAIXABANK SA VAR 05/28 | Euro | 200.608,11 | 0,17% |
| O. CAIXABANK SA VAR 06/49 | Euro | 223.254,50 | 0,18% |
| O. CAIXABANK SA VAR 11/26 | Euro | 298.878,62 | 0,25% |
| O. CARMILA SA 1,625 05/27 | Euro | 311.152,93 | 0,26% |
| O. CASSA DEPOSITI E PRESTITI 0,75 06/29 | Euro | 99.404,14 | 0,08% |
| O. CEETRUS SA 2,75 11/26 | Euro | 433.944,93 | 0,36% |
| O. CELLNEX FINANCE CO SA 1 09/27 | Euro | 388.907,56 | 0,32% |
| O. CELLNEX FINANCE CO SA 2 09/32 | Euro | 96.883,78 | 0,08% |
| O. CELLNEX TELECOM 2,875 04/25 | Euro | 217.796,38 | 0,18% |
| O. CELLNEX TELECOM SA 1,75 10/30 | Euro | 483.458,08 | 0,40% |
| O. CEPESA FINANCE SA 2,25 02/26 | Euro | 216.159,86 | 0,18% |
| O. COCA-COLA CO/THE 1,1 09/36 | Euro | 102.335,66 | 0,08% |
| O. COCA-COLA EUROPEAN PARTN 0,2 12/28 | Euro | 97.199,44 | 0,08% |
| O. COMMUNITY OF MADRID SPAIN 0,42 04/31 | Euro | 296.181,21 | 0,25% |

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|---|-----------------|----------------------|-------------------|
| O. UNICREDIT SPA VAR 09/29 | Euro | 203.001,89 | 0,17% |
| O. UNIONE DI BANCHE ITALIAN 1,625 04/25 | Euro | 261.635,68 | 0,22% |
| O. UNIPOL GRUPPO SPA 3,25 09/30 | Euro | 458.309,64 | 0,38% |
| O. UNIPOL GRUPPO SPA 3,5 11/27 | Euro | 677.114,63 | 0,56% |
| O. VALEO SA 1,5 06/25 | Euro | 312.712,77 | 0,26% |
| O. VIA OUTLETS BV 1,75 11/28 | Euro | 100.172,34 | 0,08% |
| O. WEPA HYGIENEPRODUKTE GMB 2,875 12/27 | Euro | 1.048.181,99 | 0,87% |
| O. WUESTENROT&WUERTTEMBERG VAR 09/41 | Euro | 194.083,75 | 0,16% |
| TOTAL: Renda Fixa Euro | | 87.596.206,03 | 72,57% |
| B. AFRICAN EXPORT-IMPORT 5,25 10/23 | Dólar USA | 567.507,48 | 0,47% |
| B. TOWER BERSAMA INF 4,25 01/25 | Dólar USA | 186.803,68 | 0,15% |
| B. US TREASURY N/B 0,25 05/25 | Dólar USA | 171.185,32 | 0,14% |
| B. US TREASURY N/B 1,25 11/26 | Dólar USA | 264.143,79 | 0,22% |
| O. AFRICA FINANCE CORP 2,875 04/28 | Dólar USA | 176.591,25 | 0,15% |
| O. AFRICA FINANCE CORP 3,75 10/29 | Dólar USA | 183.930,37 | 0,15% |
| O. AFRICAN EXPORT-IMPORT 3,994 09/29 | Dólar USA | 276.375,84 | 0,23% |
| O. ALLIANZ SE VAR PERP | Dólar USA | 177.507,63 | 0,15% |
| O. ALPEK SA DE CV 4,25 09/29 | Dólar USA | 189.808,21 | 0,16% |
| O. ANADOLU EFES BIR 3,375 06/28 | Dólar USA | 342.771,33 | 0,28% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 6,25 06/22 | Libra Esterlina | 503.025,34 | 0,42% |
| O. AXTEL SAB 6,375 11/24 | Dólar USA | 366.045,00 | 0,30% |
| O. COCA-COLA ICECEK 4,215 09/24 | Dólar USA | 719.157,43 | 0,60% |
| O. EASTERN & SOUTHER 4,125 06/28 | Dólar USA | 175.057,98 | 0,15% |
| O. ERICSSON LM 4,125 05/22 | Dólar USA | 358.104,07 | 0,30% |
| O. GRUPO BIMBO 5,95 VAR 04/00 | Dólar USA | 187.499,66 | 0,16% |
| O. KOC HOLDING AS 5,25 03/23 | Dólar USA | 359.383,76 | 0,30% |
| O. LOUIS DREYFUS CO BV 5,25 06/23 | Dólar USA | 370.953,39 | 0,31% |
| O. MEDIOBANCA DI CRED FIN FRN 07/24 | Dólar USA | 96.472,78 | 0,08% |
| O. MEDIOBANCA INTL LUX SA 2 03/27 | Dólar USA | 94.402,59 | 0,08% |
| O. MEDIOBANCA SPA 2,3 09/22 | Dólar USA | 626.157,97 | 0,52% |
| O. NOKIA OYJ 6,625 05/39 | Dólar USA | 122.506,18 | 0,10% |
| O. PETROBRAS GLOBAL FINANCE 5,6 01/31 | Dólar USA | 288.406,04 | 0,24% |
| O. RUMO LUXEMBOURG SARL 4,2 01/32 | Dólar USA | 168.045,42 | 0,14% |
| O. STORA ENSO 7,25 04/36 | Dólar USA | 680.464,43 | 0,56% |
| O. TELEFONICA EMISIONES SAU 7,045 06/36 | Dólar USA | 378.156,37 | 0,31% |
| O. TURK SISE VE CAM FABRIKA 6,95 03/26 | Dólar USA | 184.006,50 | 0,15% |
| O. TURKCELL 5,75 10/25 | Dólar USA | 353.375,16 | 0,29% |
| O. UNICREDIT SPA VAR 06/32 | Dólar USA | 192.632,13 | 0,16% |
| O. US TREASURY N/B 0,5 04/27 | Dólar USA | 337.883,32 | 0,28% |
| O. US TREASURY N/B 0,625 05/30 | Dólar USA | 164.665,60 | 0,14% |
| O. US TREASURY N/B 0,625 08/30 | Dólar USA | 987.155,13 | 0,82% |
| O. US TREASURY N/B 0,875 11/30 | Dólar USA | 586.245,26 | 0,49% |
| O. US TREASURY N/B 2,375 05/29 | Dólar USA | 1.551.916,70 | 1,29% |
| TOTAL: Renda Fixa No Euro | | 12.388.343,11 | 10,26% |
| TOTAL: Renda Fixa | | 99.984.549,14 | 82,83% |
| A. AIR LIQUIDE SA | Euro | 643.944,00 | 0,53% |
| A. AIRBUS SE (FP) | Euro | 449.440,00 | 0,37% |
| A. AMADEUS IT GROUP SA | Euro | 417.480,00 | 0,35% |
| A. CANCOM SE | Euro | 384.930,00 | 0,32% |
| A. CIE AUTOMOTIVE SA | Euro | 328.593,60 | 0,27% |
| A. DASSAULT AVIATION SA | Euro | 342.000,00 | 0,28% |
| A. FRESSENIUS SE & CO KGAA | Euro | 212.400,00 | 0,18% |
| A. INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA | Euro | 599.130,00 | 0,50% |
| A. JENOPTIK AG | Euro | 427.110,00 | 0,35% |
| A. KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | Euro | 204.918,00 | 0,17% |
| A. MAIRE TECNIMONT SPA | Euro | 416.000,00 | 0,34% |
| A. PROSUS NV | Euro | 205.884,00 | 0,17% |
| A. S&T AG | Euro | 146.600,00 | 0,12% |
| A. SAIPEM SPA | Euro | 202.950,00 | 0,17% |

El Fons de Pensiones en el qual està integrat el Pla, ha realitzat determinades operacions catalogades com vinculades per l'article 85 ter del RD 304/204 pel qual s'aprova el Reglament de Plans y Fons de Pensiones. Referent a això, el departament de Control Intern de la gestora ha verificat que les operacions s'han realitzat en interès exclusiu del Fons i a preus i condicions iguals o millors que els de mercat, de conformitat amb el que estableix el Reglament Intern de Conducta i en la Política d'operacions vinculades de Mediolanum Pensiones, S.G.F.P., S.A.

Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composició de la Cartera a data 31/12/2021

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|--|--------|--------------|-------------------|
| O. COMUNIDAD AUTO CANARIAS 0,714 10/31 | Euro | 99.430,73 | 0,08% |
| O. COOPERATIEVE RABOBANK UA VAR 06/49 | Euro | 439.000,47 | 0,36% |
| O. COOPERATIEVE RABOBANK VAR 06/49 | Euro | 441.244,23 | 0,37% |
| O. CPI PROPERTY GROUP SA 2,75 05/26 | Euro | 437.088,05 | 0,36% |
| O. CPI PROPERTY GROUP SA VAR 11/49 | Euro | 516.221,92 | 0,43% |
| O. CREDIT AGRICOLE SA 0,5 VAR 09/29 | Euro | 98.898,73 | 0,08% |
| O. CREDIT SUISSE GROUP AG 0,625 01/33 | Euro | 187.831,78 | 0,16% |
| O. CRITERIA CAIXA SA 0,875 10/27 | Euro | 202.063,64 | 0,17% |
| O. CROWN EURO HOLDINGS SA 2,625 09/24 | Euro | 313.694,63 | 0,26% |
| O. CTP NV 1,25 06/29 | Euro | 197.378,77 | 0,16% |
| O. CXGD 10,75 PERP VAR 03/00 | Euro | 822.558,89 | 0,68% |
| O. DE VOLKSBANK NV 0,375 03/28 | Euro | 197.100,66 | 0,16% |
| O. DEUDA PUBLICA 1,25 10/30 | Euro | 1.073.643,29 | 0,89% |
| O. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2,875 05/27 | Euro | 197.304,66 | 0,16% |
| O. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3,5 07/29 | Euro | 201.639,45 | 0,17% |
| O. DS SMITH PLC 0,875 09/26 | Euro | 203.556,19 | 0,17% |
| O. EASYJET FINCO BV 1,875 03/28 | Euro | 204.259,29 | 0,17% |
| O. EASYJET PLC 0,875 06/25 | Euro | 202.200,08 | 0,17% |
| O. EL CORTE INGLES SA 3 03/24 | Euro | 1.114.985,67 | 0,92% |
| O. ENEL SPA VAR 11/49 | Euro | 328.597,11 | 0,27% |
| O. ENI SPA VAR 2 05/49 | Euro | 201.953,34 | 0,17% |
| O. EUROFINS SCIENTIFIC 2,125 07/24 | Euro | 157.471,41 | 0,13% |
| O. EUROFINS SCIENTIFIC SE 0,875 05/31 | Euro | 98.989,18 | 0,08% |
| O. EURONET WORLDWIDE INC 1,375 05/26 | Euro | 822.494,68 | 0,68% |
| O. EUTELSAT SA 1,5 10/28 | Euro | 203.557,53 | 0,17% |
| O. EUTELSAT SA 2 10/25 | Euro | 104.311,63 | 0,09% |
| O. EUTELSAT SA 2,25 07/27 | Euro | 105.514,27 | 0,09% |
| O. EXPEDIA 2,5 06/22 | Euro | 509.315,27 | 0,42% |
| O. FCC AQUALIA SA 2,629 06/27 | Euro | 1.112.399,67 | 0,92% |
| O. FCE BANK 1,615 05/23 | Euro | 515.558,97 | 0,43% |
| O. FIDELIDADE CIA SEGUROS VAR 09/31 | Euro | 325.681,85 | 0,27% |
| O. GESTAMP AUTOMOCION 3,25 04/26 | Euro | 912.651,25 | 0,76% |
| O. GLOBALWORTH REAL ESTATE 2,95 07/26 | Euro | 428.639,29 | 0,36% |
| O. GRIFOLS SA 3,2 05/25 | Euro | 1.208.116,00 | 1,00% |
| O. HAMMERSON IRELAND 1,75 06/27 | Euro | 397.865,75 | 0,33% |
| O. HEIMSTADEN AB 4,375 03/27 | Euro | 507.737,85 | 0,42% |
| O. HEIMSTADEN BOSTA VAR 01/49 | Euro | 389.259,07 | 0,32% |
| O. HIPERCOR SA 3,875 01/22 | Euro | 936.530,14 | 0,78% |
| O. ILIAD SA 1,5 10/24 | Euro | 100.810,66 | 0,08% |
| O. ILIAD SA 1,875 02/28 | Euro | 291.463,15 | 0,24% |
| O. ILIAD SA 1,875 04/25 | Euro | 102.089,38 | 0,08% |
| O. IMMOBILIARE GRANDE DIST 2,65 04/22 | Euro | 1.122.807,07 | 0,93% |
| O. INDRA SISTEMAS 3 04/24 | Euro | 319.674,99 | 0,26% |
| O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,625 10/28 | Euro | 304.996,64 | 0,25% |
| O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,75 04/31 | Euro | 402.524,77 | 0,33% |
| O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,875 07/26 | Euro | 104.348,25 | 0,09% |
| O. INTESA SANPAOLO SPA 0,75 03/28 | Euro | 200.917,89 | 0,17% |
| O. INTESA SANPAOLO SPA 1,35 02/31 | Euro | 298.314,82 | 0,25% |
| O. INTESA SANPAOLO SPA 6,625 09/23 | Euro | 336.628,73 | 0,28% |
| O. INTL CONSOLIDATED AIR 0,625 11/22 | Euro | 492.233,47 | 0,41% |
| O. INTL CONSOLIDATED AIRLINES 1,5 07/27 | Euro | 360.107,34 | 0,30% |
| O. INTL CONSOLIDATED AIRLINES 3,75 03/29 | Euro | 100.989,26 | 0,08% |
| O. ISLANDSBANKI 1,125 VAR 01/24 | Euro | 305.899,56 | 0,25% |

(expressat en euros)

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|---|---------------|-----------------------|-------------------|
| A. SANOFI SA | Euro | 221.450,00 | 0,18% |
| A. SAP SE | Euro | 224.820,00 | 0,19% |
| TOTAL: Renda Variable Euro | | 5.427.649,60 | 4,50% |
| A. ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | Dólar USA | 386.563,76 | 0,32% |
| A. ALPHABET INC-CL A | Dólar USA | 1.223.024,80 | 1,01% |
| A. AMAZON.COM INC | Dólar USA | 967.750,40 | 0,80% |
| A. APPLE INC | Dólar USA | 655.931,40 | 0,54% |
| A. BARRICK GOLD CORP | Dólar USA | 417.766,05 | 0,35% |
| A. BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | Dólar USA | 1.314.863,68 | 1,09% |
| A. BOEING CO | Dólar USA | 407.243,62 | 0,34% |
| A. BOOKING HOLDINGS INC | Dólar USA | 211.014,07 | 0,17% |
| A. CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | Dólar Canadá | 316.454,38 | 0,26% |
| A. CHECK POINT SOFTWARE TECH | Dólar USA | 420.313,10 | 0,35% |
| A. CONSTELLATION SOFTWARE INC | Dólar Canadá | 440.819,62 | 0,37% |
| A. FACEBOOK INC-A | Dólar USA | 1.301.618,29 | 1,08% |
| A. FISERV INC | Dólar USA | 209.953,39 | 0,17% |
| A. GOLAR LNG LTD | Dólar USA | 217.941,95 | 0,18% |
| A. HEICO CORP | Dólar USA | 304.422,16 | 0,25% |
| A. JD.COM INC-ADR | Dólar USA | 166.393,14 | 0,14% |
| A. JSC KASPI.KZ GDR-REG | Dólar USA | 367.282,32 | 0,30% |
| A. KROGER CO | Dólar USA | 203.013,19 | 0,17% |
| A. LOWES COS INC | Dólar USA | 318.269,13 | 0,26% |
| A. MERCK & CO INC | Dólar USA | 208.956,90 | 0,17% |
| A. MICROSOFT CORP | Dólar USA | 828.228,67 | 0,69% |
| A. MOODYS CORP | Dólar USA | 377.869,83 | 0,31% |
| A. NOVO NORDISC A/S-B | Corona Danesa | 632.513,11 | 0,52% |
| A. ORACLE CORP | Dólar USA | 391.179,42 | 0,32% |
| A. PALO ALTO NETWORKS INC | Dólar USA | 416.223,39 | 0,34% |
| A. PAYPAL HOLDINGS INC | Dólar USA | 298.543,54 | 0,25% |
| A. PINDUODUO INC-ADR | Dólar USA | 97.423,04 | 0,08% |
| A. ROCHE HOLDING AG | Franco Suïzo | 621.235,78 | 0,51% |
| A. S&P GLOBAL INC | Dólar USA | 415.065,96 | 0,34% |
| A. STARBUCKS CORP | Dólar USA | 318.915,57 | 0,26% |
| A. TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR | Dólar USA | 211.627,09 | 0,18% |
| A. TENCENT HOLDINGS LTD-UNS ADR | Dólar USA | 97.423,04 | 0,08% |
| A. THE COCA-COLA CO | Dólar USA | 447.850,48 | 0,37% |
| A. VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | Dólar USA | 84.221,64 | 0,07% |
| TOTAL: Renda Variable No Euro | | 15.297.915,91 | 12,67% |
| TOTAL: Renda Variable | | 20.725.565,51 | 17,17% |
| TOTAL CARTERA (**) | | 120.710.114,65 | 100,00% |
| CARTERA INSTRUMENTS DERIVATS (*) | | | |
| F. EURO FX CURR FUT MAR22 | Dólar USA | 16.459.374,59 | |
| TOTAL: Futurs No Euro | | 16.459.374,59 | |
| TOTAL: Futurs | | 16.459.374,59 | |
| O.C. EUROSTOXX BANKS 140 MAR22 (C) | Euro | 88.150,00 | |
| O.P. EURO STOXX50 3500 JUN22 (V) | Euro | 9.420,00 | |
| O.P. EURO STOXX50 4200 JUN22 (C) | Euro | 30.870,00 | |
| TOTAL: Opcions Euro | | 128.440,00 | |
| TOTAL: Opcions | | 128.440,00 | |
| TOTAL DERIVADOS: | | 16.587.814,59 | |

(*) Instruments Derivats amb signe negatiu impliquen que són operacions de venda.
(**) La diferència entre patrimoni i total cartera són la liquiditat, els deutors i els creditors.

El Fons de Pensiones en el qual està integrat el Pla, ha realitzat determinades operacions catalogades com vinculades per l'article 85 ter del RD 304/204 pel qual s'aprova el Reglament de Plans y Fons de Pensiones. Referent a això, el departament de Control Intern de la gestora ha verificat que les operacions s'han realitzat en interès exclusiu del Fons i a preus i condicions iguals o millors que els de mercat, de conformitat amb el que estableix el Reglament Intern de Conducta i en la Política d'operacions vinculades de Mediolanum Pensiones, S.G.F.P., S.A.

Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composició de la Cartera a data 30/06/2021

(expressat en euros)

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|--|--------|--------------|-------------------|
| CARTERA DE VALORS | | | |
| **O. BANCO BILBAO VIZCAYA ARG VAR 09/49 | Euro | 216.633,51 | 0,21% |
| *B. ACCIONA FINANCIACION FIL 0,558 10/21 | Euro | 903.930,90 | 0,89% |
| *B. ADLER REAL ESTATE AG 1,5 12/21 | Euro | 301.898,05 | 0,30% |
| *B. BULGARIAN ENERGY HLD 4,875 08/21 | Euro | 734.213,22 | 0,72% |
| *B. FCE BANK PLC 0,869 09/21 | Euro | 302.564,46 | 0,30% |
| *B. INTESA SANPAOLO SPA 0,75 12/24 | Euro | 103.019,45 | 0,10% |
| *B. KUTXABANK SA 0,5 09/24 | Euro | 101.888,19 | 0,10% |
| *O. ARCELK AS 3,875 09/21 | Euro | 103.784,53 | 0,10% |
| *O. ASTURIANA DE LAMINADOS 6,5 07/23 | Euro | 192.044,25 | 0,19% |
| *O. NEMAK SAB CV 3,25 03/24 | Euro | 307.910,83 | 0,30% |
| *O. REPUBLICA MACEDONIA 3,975 07/21 | Euro | 832.972,16 | 0,82% |
| B. ACS SERVICIOS 1,875 04/26 | Euro | 531.374,32 | 0,52% |
| B. ARCELORMITTAL 1 05/23 | Euro | 407.155,23 | 0,40% |
| B. ARION BANKI HF 0,625 05/24 | Euro | 403.759,73 | 0,40% |
| B. ARION BANKI HF 1 03/23 | Euro | 508.980,96 | 0,50% |
| B. BANCO DE SABADELL 0,7 03/22 | Euro | 145.879,58 | 0,14% |
| B. BANCO ESPIRITO SANTO 6,875 07/49 | Euro | 26.433,50 | 0,03% |
| B. BANKIA SA 1 06/24 | Euro | 410.829,75 | 0,40% |
| B. BPER BANCA 1,875 07/25 | Euro | 212.261,84 | 0,21% |
| B. CAIXABANK SA 0,625 10/24 | Euro | 714.892,26 | 0,70% |
| B. CAIXABANK SA 2,375 02/24 | Euro | 321.456,08 | 0,32% |
| B. CELLNEX FINANCE CO SA 0,75 11/26 | Euro | 99.587,45 | 0,10% |
| B. CEPESA FINANCE SA 0,75 02/28 | Euro | 683.743,32 | 0,67% |
| B. CIE DE PHALSBURG 5 03/24 | Euro | 406.495,87 | 0,40% |
| B. CROWN EURO HOLDINGS SA 0,75 02/23 | Euro | 503.323,84 | 0,49% |
| B. CTP BV 2,125 10/25 | Euro | 429.629,53 | 0,42% |
| B. ESPIRITO SANTO 5,25 06/15 | Euro | 20.460,00 | 0,02% |
| B. FCC AQUALIA SA 1,413 06/22 | Euro | 909.819,35 | 0,89% |
| B. FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 3,375 07/23 | Euro | 437.898,08 | 0,43% |
| B. FIN IMMOBILIERE BORDELAI 6,00 01/25 | Euro | 479.732,15 | 0,47% |
| B. FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1,514 02/23 | Euro | 306.575,47 | 0,30% |
| B. HEIMSTADEN AB 4,25 03/26 | Euro | 413.788,89 | 0,41% |
| B. IMMOBILIARE GRANDE DIST 2,125 11/24 | Euro | 1.117.277,84 | 1,10% |
| B. INTESA SANPAOLO SPA 1 07/24 | Euro | 311.993,34 | 0,31% |
| B. INTL CONSOLIDATED AIRLIN 2,75 03/25 | Euro | 403.685,42 | 0,40% |
| B. INVITALIA 1,375 07/22 | Euro | 205.524,84 | 0,20% |
| B. LANDSBANKINN HF 0,375 05/25 | Euro | 199.652,14 | 0,20% |
| B. LANDSBANKINN HF 0,50 05/24 | Euro | 503.097,67 | 0,49% |
| B. LOUIS DREYFUS CO BV 2,375 11/25 | Euro | 215.100,96 | 0,21% |
| B. MEDIABANCA DI CRED FIN ESC 01/24 | Euro | 332.927,47 | 0,33% |
| B. NE PROPERTY BV 2,625 05/23 | Euro | 730.335,70 | 0,72% |
| B. NH HOTEL GROUP SA 4 07/26 | Euro | 300.539,63 | 0,30% |
| B. NOS SGPS 1,125 05/23 | Euro | 509.069,66 | 0,50% |
| B. PCF GMBH 4,75 04/26 | Euro | 206.359,03 | 0,20% |
| B. POSCO 0,5 01/24 | Euro | 303.216,08 | 0,30% |
| B. PPF TELECOM GROUP BV 3,5 05/24 | Euro | 428.646,96 | 0,42% |
| B. REP. MACEDONIA 5,625 07/23 | Euro | 345.647,18 | 0,34% |
| B. SA DE OBRAS SERVICIOS 6 07/22 | Euro | 424.731,67 | 0,42% |
| B. SERVICIOS MEDIO AMBIENTE 1,661 12/26 | Euro | 213.412,19 | 0,21% |
| B. UNICREDIT SPA 1 01/23 | Euro | 715.199,21 | 0,70% |
| B. UNIONE DI BANCHE ITALIA 2,625 04/24 | Euro | 536.060,55 | 0,53% |
| B. UNIONE DI BANCHE ITALIAN 1,75 04/23 | Euro | 207.491,12 | 0,20% |
| B. VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0 07/24 | Euro | 199.886,00 | 0,20% |
| B. VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0,375 07/26 | Euro | 100.419,18 | 0,10% |
| B. ZF FINANCE GMBH 3 09/25 | Euro | 325.569,08 | 0,32% |
| O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 01/49 | Euro | 215.933,63 | 0,21% |
| O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 01/29 | Euro | 225.086,11 | 0,22% |

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|---|-----------|----------------------|-------------------|
| O. MOTA ENGL SGPS 4 01/23 | Euro | 305.426,33 | 0,30% |
| O. MUTUELLE ASSURANCE 0,625 06/27 | Euro | 99.527,12 | 0,10% |
| O. NE PROPERTY BV 1,875 10/26 | Euro | 625.687,81 | 0,62% |
| O. NE PROPERTY BV 3,375 07/27 | Euro | 229.091,59 | 0,23% |
| O. NESTLE FINANCE INTL LTD 0 03/33 | Euro | 189.004,00 | 0,19% |
| O. NESTLE FINANCE INTL LTD 0,375 12/40 | Euro | 370.399,01 | 0,36% |
| O. NEW AREVA HOLDING 4,875 09/24 | Euro | 292.850,21 | 0,29% |
| O. NN GROUP NV VAR 04/44 (CALL4/24) | Euro | 788.776,68 | 0,78% |
| O. NOKIA OYJ 2 03/24 | Euro | 210.135,56 | 0,21% |
| O. NORTEGAS ENERGIA DISTRI 0,905 01/31 | Euro | 198.483,42 | 0,20% |
| O. NORTH MACEDONIA 1,625 03/28 | Euro | 198.682,16 | 0,20% |
| O. ORANO SA 2,75 03/28 | Euro | 211.088,88 | 0,21% |
| O. ORANO SA 3,125 03/23 | Euro | 210.559,70 | 0,21% |
| O. ORANO SA 3,375 04/26 | Euro | 218.286,03 | 0,21% |
| O. PARPUBLICA FRN 10/27 | Euro | 194.028,00 | 0,19% |
| O. POSTE ITALIANE SPA VAR 06/49 | Euro | 200.094,68 | 0,20% |
| O. RAIFFEISEN BANK INTL VAR 06/49 | Euro | 212.197,52 | 0,21% |
| O. RAIFFEISEN LB NIEDEROEST 5,875 11/23 | Euro | 574.288,56 | 0,56% |
| O. RAIFFEISENBANK AS VAR 06/28 | Euro | 100.145,27 | 0,10% |
| O. RENAULT SA 1 04/24 | Euro | 199.957,48 | 0,20% |
| O. ROMANIA 2,124 07/31 | Euro | 105.486,71 | 0,10% |
| O. ROMANIA 2,875 05/28 | Euro | 336.292,68 | 0,33% |
| O. ROMANIA 3,375 02/38 | Euro | 111.234,26 | 0,11% |
| O. SAIPEM FINANCE INTL BV 3,125 03/28 | Euro | 206.619,34 | 0,20% |
| O. SAIPEM FINANCE INTL BV 3,75 09/23 | Euro | 327.861,29 | 0,32% |
| O. SECURITAS AB 0,25 02/28 | Euro | 196.996,71 | 0,19% |
| O. SIGMA ALIMENTOS 2,625 02/24 | Euro | 213.681,23 | 0,21% |
| O. STELLANTIS NV 0,625 03/27 | Euro | 201.370,49 | 0,20% |
| O. SUMMIT PROP 2,00 01/25 | Euro | 299.217,00 | 0,29% |
| O. TELECOM ITALIA SPA 1,625 01/29 | Euro | 99.285,14 | 0,10% |
| O. TELEFONAKTIEBOLAGET LM 1 05/29 | Euro | 100.913,63 | 0,10% |
| O. TELEFONICA EMISIONES SAU 0,664 02/30 | Euro | 305.049,72 | 0,30% |
| O. TELEFONICA EUROPE BV VAR 03/49 | Euro | 564.659,11 | 0,56% |
| O. TEOLLISUUJEN VOIMA 2 05/24 | Euro | 416.639,56 | 0,41% |
| O. TEOLLISUUJEN VOIMA OYJ 1,125 03/26 | Euro | 607.394,22 | 0,60% |
| O. TEOLLISUUJEN VOIMA OYJ 1,375 06/28 | Euro | 299.232,41 | 0,29% |
| O. UNIBAIL-RODAMCO-WESTFLD VAR 10/49 | Euro | 503.898,29 | 0,50% |
| O. UNICREDIT SPA 0,85 01/31 | Euro | 395.118,36 | 0,39% |
| O. UNICREDIT SPA 6,95 10/22 | Euro | 682.103,92 | 0,67% |
| O. UNICREDIT SPA FRN 08/24 | Euro | 300.587,33 | 0,30% |
| O. UNIONE DI BANCHE ITALIAN 1,625 04/25 | Euro | 262.215,24 | 0,26% |
| O. UNIPOL GRUPPO SPA 3,25 09/30 | Euro | 576.265,27 | 0,57% |
| O. UNITED MEXICAN STATES 1,35 09/27 | Euro | 209.747,62 | 0,21% |
| O. UPM-KYMMENE OYJ 0,125 11/28 | Euro | 98.537,71 | 0,10% |
| O. VALEO SA 1,5 06/25 | Euro | 103.195,42 | 0,10% |
| O. VEOLIA ENVIRONNEMENT SA VAR 04/49 | Euro | 515.929,18 | 0,51% |
| O. VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0,625 07/29 | Euro | 100.092,63 | 0,10% |
| O. WEPA HYGIENEPRODUKTE GMB 2,875 12/27 | Euro | 693.487,78 | 0,68% |
| O. ZF NA CAPITAL 2,75 04/23 | Euro | 209.887,45 | 0,21% |
| P. PREF. UNION FENOSA FRN 09/49 | Euro | 150.028,09 | 0,15% |
| TOTAL: Renda Fixa Euro | | 77.771.979,95 | 76,47% |
| *O. ANADOLU EFES 3,375 11/22 | Dólar USA | 173.686,12 | 0,17% |
| *O. NEMAK SAB 4,75 01/25 | Dólar USA | 356.170,43 | 0,35% |
| B. AFRICAN EXPORT-IMPORT 5,25 10/23 | Dólar USA | 553.695,40 | 0,54% |
| B. TOWER BERSAMA INF 4,25 01/25 | Dólar USA | 181.581,87 | 0,18% |
| B. US TREASURY N/B 0,25 05/25 | Dólar USA | 165.865,22 | 0,16% |
| O. AFRICA FINANCE CORP 2,875 04/28 | Dólar USA | 170.286,94 | 0,17% |
| O. AFRICA FINANCE CORP 3,75 10/29 | Dólar USA | 178.244,92 | 0,18% |

El Fons de Pensiones en el qual està integrat el Pla, ha realitzat determinades operacions catalogades com vinculades per l'article 85 ter del RD 304/2004 pel qual s'aprova el Reglament de Plans y Fons de Pensiones. Referent a això, el departament de Control Intern de la gestora ha verificat que les operacions s'han realitzat en interès exclusiu del Fons i a preus i condicions iguals o millors que els de mercat, de conformitat amb el que estableix el Reglament Intern de Conducta i en la Política d'operacions vinculades de Mediolanum Pensiones, S.G.F.P., S.A.

Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composició de la Cartera a data 30/06/2021

(expressat en euros)

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|--|--------|--------------|-------------------|
| O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 04/30 | Euro | 217.260,11 | 0,21% |
| O. ABERTIS INFRAESTRUCTURAS 2,25 03/29 | Euro | 220.746,90 | 0,22% |
| O. AEGON NV FRN 07/49 | Euro | 173.658,00 | 0,17% |
| O. ARCELORMITTAL 0,95 01/23 | Euro | 1.017.004,52 | 1,00% |
| O. ARCELORMITTAL 1,75 11/25 | Euro | 427.259,89 | 0,42% |
| O. AROUNDTOWN SA VAR 07/49 | Euro | 97.203,49 | 0,10% |
| O. ASSICURAZIONI GEN VAR 10/47-CALL10/27 | Euro | 254.437,84 | 0,25% |
| O. ASSICURAZIONI GENERALI VAR 06/48 | Euro | 365.838,21 | 0,36% |
| O. ATRADIUS VAR 09/44 (CALL 9/24) | Euro | 926.886,25 | 0,91% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 1,75 06/26 | Euro | 518.489,86 | 0,51% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 1,875 11/25 | Euro | 105.534,74 | 0,10% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 2 01/30 | Euro | 104.538,07 | 0,10% |
| O. AUTOSTRADE PER LITALIA 2 12/28 | Euro | 211.034,41 | 0,21% |
| O. BANCO COMERC PORTUGUES VAR 02/27 | Euro | 197.386,85 | 0,19% |
| O. BANCO DE SABADELL SA VAR 06/28 | Euro | 197.341,92 | 0,19% |
| O. BANKIA SA 1,125 11/26 | Euro | 832.111,89 | 0,82% |
| O. BANKIA SA VAR 6,375 PERP 09/49 | Euro | 219.073,76 | 0,22% |
| O. BANKINTER SA 0,625 10/27 | Euro | 303.962,71 | 0,30% |
| O. BANKINTER SA 0,875 07/26 | Euro | 309.981,66 | 0,30% |
| O. BASQUE GOVERNMENT 0,25 04/31 | Euro | 295.282,40 | 0,29% |
| O. BCO COM PORTUGUES VAR 12/27 | Euro | 212.325,45 | 0,21% |
| O. BCOMPOR VAR 03/30 | Euro | 204.750,25 | 0,20% |
| O. BESPL SA 7,125 11/23 | Euro | 244,00 | 0,00% |
| O. BEVCO LUX SARL 1 01/30 | Euro | 396.844,38 | 0,39% |
| O. BEVCO LUX SARL 1,5 09/27 | Euro | 212.411,12 | 0,21% |
| O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0,1 04/31 | Euro | 1.067.274,85 | 1,05% |
| O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1,45 04/29 | Euro | 441.389,21 | 0,43% |
| O. BP CAPITAL MARKETS PLC VAR 06/49 | Euro | 749.770,96 | 0,74% |
| O. BPER BANCA VAR 03/27 | Euro | 303.412,73 | 0,30% |
| O. BULGARIAN ENERGY HLD 3,5 06/25 | Euro | 322.358,30 | 0,32% |
| O. BUONI POLIENNALI DEL TES 0,9 04/31 | Euro | 101.432,38 | 0,10% |
| O. BUONI POLIENNALI DEL TES 1,65 12/30 | Euro | 1.951.672,50 | 1,92% |
| O. BUONI POLIENNALI DEL TES ESC 07/30 | Euro | 524.061,60 | 0,52% |
| O. CAIXABANK SA VAR 02/29 | Euro | 197.581,04 | 0,19% |
| O. CAIXABANK SA VAR 05/28 | Euro | 201.473,95 | 0,20% |
| O. CAIXABANK SA VAR 06/49 | Euro | 226.658,33 | 0,22% |
| O. CAIXABANK SA VAR 11/26 | Euro | 301.248,49 | 0,30% |
| O. CARMILA SA 1,625 05/27 | Euro | 307.831,40 | 0,30% |
| O. CASSA DEPOSITI E PRESTITI 0,75 06/29 | Euro | 201.224,10 | 0,20% |
| O. CDP RETI SPA 1,875 05/22 | Euro | 305.947,56 | 0,30% |
| O. CEETRUS SA 2,75 11/26 | Euro | 444.035,73 | 0,44% |
| O. CELANESE US HOLDINGS 1,125 09/23 | Euro | 309.836,55 | 0,30% |
| O. CELLNEX FINANCE CO SA 2 02/33 | Euro | 99.919,21 | 0,10% |
| O. CELLNEX TELECOM SA 1,75 10/30 | Euro | 504.357,12 | 0,50% |
| O. CEPSA FINANCE SA 2,25 02/26 | Euro | 216.675,37 | 0,21% |
| O. COCA-COLA CO/THE 1,1 09/36 | Euro | 104.266,14 | 0,10% |
| O. COCA-COLA EUROPEAN PARTN 0,2 12/28 | Euro | 197.761,23 | 0,19% |
| O. COMMUNITY OF MADRID SPAIN 0,42 04/31 | Euro | 297.664,03 | 0,29% |
| O. COOPERATIVE RABOBANK UA VAR 06/49 | Euro | 440.293,09 | 0,43% |
| O. COOPERATIVE RABOBANK VAR 06/49 | Euro | 444.311,63 | 0,44% |
| O. CPI PROPERTY GROUP SA 2,75 05/26 | Euro | 437.470,85 | 0,43% |
| O. CPI PROPERTY GROUP SA VAR 11/49 | Euro | 548.562,88 | 0,54% |
| O. CREDIT SUISSE GROUP AG 0,625 01/33 | Euro | 188.911,64 | 0,19% |
| O. CRITERIA CAIXA SA 0,875 10/27 | Euro | 204.279,45 | 0,20% |
| O. CRITERIA CAIXA SA 1,5 05/23 | Euro | 825.381,59 | 0,81% |
| O. CROWN EURO HOLDINGS SA 2,625 09/24 | Euro | 316.458,75 | 0,31% |
| O. CTP NV 1,25 06/29 | Euro | 198.034,49 | 0,19% |
| O. DANONE SA 0,395 06/29 | Euro | 101.630,73 | 0,10% |
| O. DE VOLKSBANK NV 0,375 03/28 | Euro | 198.284,58 | 0,19% |

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|--|-----------|----------------------|-------------------|
| O. AFRICAN EXPORT-IMPORT 3,994 09/29 | Dólar USA | 269.442,01 | 0,26% |
| O. ALPEK SA DE CV 4,25 09/29 | Dólar USA | 185.474,73 | 0,18% |
| O. ANADOLU EFES BIR 3,375 06/28 | Dólar USA | 338.376,62 | 0,33% |
| O. AXTEL SAB 6,375 11/24 | Dólar USA | 355.342,53 | 0,35% |
| O. COCA-COLA ICECEK 4,215 09/24 | Dólar USA | 718.220,61 | 0,71% |
| O. EASTERN & SOUTHER 4,125 06/28 | Dólar USA | 168.489,56 | 0,17% |
| O. ERICSSON LM 4,125 05/22 | Dólar USA | 348.912,41 | 0,34% |
| O. GRUPO BIMBO 5,95 VAR 04/00 | Dólar USA | 182.709,66 | 0,18% |
| O. KINGDOM OF MOROCCO 2,375 12/27 | Dólar USA | 166.121,70 | 0,16% |
| O. KOC HOLDING AS 5,25 03/23 | Dólar USA | 354.517,90 | 0,35% |
| O. LOUIS DREYFUS CO BV 5,25 06/23 | Dólar USA | 181.533,99 | 0,18% |
| O. MEDIOBANCA SPA 2,3 09/22 | Dólar USA | 611.631,57 | 0,60% |
| O. NOKIA OYJ 6,625 05/39 | Dólar USA | 111.000,62 | 0,11% |
| O. PETROBRAS GLOBAL FINANCE 5,6 01/31 | Dólar USA | 290.798,34 | 0,29% |
| O. STORA ENSO 7,25 04/36 | Dólar USA | 631.916,77 | 0,62% |
| O. TELEFONICA EMISIONES SAU 7,045 06/36 | Dólar USA | 365.574,12 | 0,36% |
| O. TURKCELL 5,75 10/25 | Dólar USA | 183.492,81 | 0,18% |
| O. US TREASURY N/B 0,5 04/27 | Dólar USA | 327.294,11 | 0,32% |
| O. US TREASURY N/B 0,625 05/30 | Dólar USA | 157.649,60 | 0,16% |
| O. US TREASURY N/B 0,625 08/30 | Dólar USA | 944.382,64 | 0,93% |
| O. US TREASURY N/B 0,875 11/30 | Dólar USA | 561.462,53 | 0,55% |
| O. US TREASURY N/B 2,375 05/29 | Dólar USA | 2.233.959,54 | 2,20% |
| TOTAL: Renda Fixa No Euro | | 11.467.835,27 | 11,28% |
| TOTAL: Renda Fixa | | 89.239.815,22 | 87,75% |
| *A. FLATEX AG | Euro | 331.306,50 | 0,33% |
| *A. SACYR SA JUN21 | Euro | 668,30 | 0,00% |
| A. ACCOR SA | Euro | 85.841,74 | 0,08% |
| A. ADIDAS AG | Euro | 181.434,20 | 0,18% |
| A. AIR LIQUIDE SA | Euro | 295.910,64 | 0,29% |
| A. AIRBUS SE (FP) | Euro | 227.615,56 | 0,22% |
| A. ALANTRA PARTNERS SA | Euro | 29.978,80 | 0,03% |
| A. ALSTOM SA | Euro | 103.664,06 | 0,10% |
| A. ALTRI SGPS SA | Euro | 41.920,00 | 0,04% |
| A. ASM INTERNATIONAL NV | Euro | 277.554,00 | 0,27% |
| A. ASML HOLDING NV | Euro | 147.167,60 | 0,14% |
| A. AXA SA | Euro | 113.875,13 | 0,11% |
| A. BANKINTER SA | Euro | 189.724,92 | 0,19% |
| A. BOLLORE | Euro | 45.200,00 | 0,04% |
| A. BUREAU VERITAS SA | Euro | 132.226,08 | 0,13% |
| A. CAPGEMINI SE | Euro | 195.858,00 | 0,19% |
| A. CELLNEX TELECOM SAU | Euro | 498.629,04 | 0,49% |
| A. CIE AUTOMOTIVE SA | Euro | 81.793,92 | 0,08% |
| A. COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | Euro | 102.193,60 | 0,10% |
| A. CONSTRUCCIONES Y AUX DE FERROCARRILES | Euro | 106.650,00 | 0,10% |
| A. DAIMLER AG-REG SHARES | Euro | 112.950,00 | 0,11% |
| A. DANONE | Euro | 369.162,66 | 0,36% |
| A. E.ON SE | Euro | 130.196,39 | 0,13% |
| A. ENDESA SA | Euro | 193.101,48 | 0,19% |
| A. EURONAV NV | Euro | 44.931,04 | 0,04% |
| A. EVONIK INDUSTRIES AG | Euro | 48.387,08 | 0,05% |
| A. FRESENIUS SE & CO KGAA | Euro | 146.723,33 | 0,14% |
| A. GLOBAL DOMINION ACCESS SA | Euro | 56.810,00 | 0,06% |
| A. GRIFOLS SA | Euro | 479.525,80 | 0,47% |
| A. HANNOVER RUECK SE | Euro | 79.298,20 | 0,08% |
| A. INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA | Euro | 115.512,48 | 0,11% |
| A. ING GROEP NV-CVA | Euro | 137.478,74 | 0,14% |
| A. KONINKLIJKE PHILIPS NV | Euro | 259.808,43 | 0,26% |
| A. LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI SA | Euro | 298.482,40 | 0,29% |
| A. LOREAL SA | Euro | 350.997,20 | 0,35% |

El Fons de Pensiones en el qual està integrat el Pla, ha realitzat determinades operacions catalogades com vinculades per l'article 85 ter del RD 304/204 pel qual s'aprova el Reglament de Plans y Fons de Pensiones. Referent a això, el departament de Control Intern de la gestora ha verificat que les operacions s'han realitzat en interès exclusiu del Fons i a preus i condicions iguals o millors que els de mercat, de conformitat amb el que estableix el Reglament Intern de Conducta i en la Política d'operacions vinculades de Mediolanum Pensiones, S.G.F.P., S.A.

Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composició de la Cartera a data 30/06/2021

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|--|--------|--------------|-------------------|
| O. DEUDA PUBLICA 1,25 10/30 | Euro | 1.310.018,30 | 1,29% |
| O. DS SMITH PLC 0,875 09/26 | Euro | 308.970,00 | 0,30% |
| O. EL CORTE INGLÉS SA 3 03/24 | Euro | 714.471,33 | 0,70% |
| O. ENEL FINANCE INTL NV 0 06/27 | Euro | 197.754,00 | 0,19% |
| O. ENEL SPA VAR 11/49 | Euro | 338.805,00 | 0,33% |
| O. ENI SPA VAR 2 05/49 | Euro | 200.722,90 | 0,20% |
| O. EUROFINS SCIENTIFIC 2,125 07/24 | Euro | 160.869,75 | 0,16% |
| O. EUROFINS SCIENTIFIC SE 0,875 05/31 | Euro | 298.440,25 | 0,29% |
| O. EURONET WORLDWIDE INC 1,375 05/26 | Euro | 609.586,11 | 0,60% |
| O. EUROPEAN UNION 0,10 10/40 | Euro | 185.599,34 | 0,18% |
| O. EUROPEAN UNION 0,3 11/50 | Euro | 273.803,26 | 0,27% |
| O. EXPEDIA 2,5 06/22 | Euro | 509.428,90 | 0,50% |
| O. FCC AQUALIA SA 2,629 06/27 | Euro | 1.108.776,63 | 1,09% |
| O. FCE BANK 1,615 05/23 | Euro | 511.298,29 | 0,50% |
| O. FCE BANK PLC 1,134 2/22 | Euro | 101.051,07 | 0,10% |
| O. FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 3,75 03/24 | Euro | 111.034,75 | 0,11% |
| O. GRIFOLS SA 3,2 05/25 | Euro | 1.218.724,00 | 1,20% |
| O. H&M FINANCE BV 0,25 08/29 | Euro | 98.139,30 | 0,10% |
| O. HAMMERSON IRELAND 1,75 06/27 | Euro | 401.688,99 | 0,39% |
| O. HEMSTADEN BOSTA VAR 01/49 | Euro | 399.993,75 | 0,39% |
| O. HIPERCOR SA 3,875 01/22 | Euro | 935.059,32 | 0,92% |
| O. IBERDROLA INTL BV VAR 04/49 | Euro | 103.600,59 | 0,10% |
| O. ILIAD SA 1,5 10/24 | Euro | 102.592,49 | 0,10% |
| O. ILIAD SA 1,875 02/28 | Euro | 297.993,53 | 0,29% |
| O. ILIAD SA 1,875 04/25 | Euro | 102.298,18 | 0,10% |
| O. IMMOBILIARE GRANDE DIST 2,65 04/22 | Euro | 904.003,02 | 0,89% |
| O. INDRA SISTEMAS 3 04/24 | Euro | 104.567,00 | 0,10% |
| O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,625 10/28 | Euro | 309.211,11 | 0,30% |
| O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,75 04/31 | Euro | 401.008,00 | 0,39% |
| O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,875 07/26 | Euro | 106.388,04 | 0,10% |
| O. INMOBILIARIA COLONIAL 0,75 06/29 | Euro | 198.350,99 | 0,20% |
| O. INTESA SANPAOLO SPA 0,75 03/28 | Euro | 201.739,73 | 0,20% |
| O. INTESA SANPAOLO SPA 1,35 02/31 | Euro | 301.448,18 | 0,30% |
| O. INTESA SANPAOLO SPA 6,625 09/23 | Euro | 355.769,55 | 0,35% |
| O. INTL CONSOLIDATED AIR 0,625 11/22 | Euro | 486.477,13 | 0,48% |
| O. INTL CONSOLIDATED AIRLINES 1,5 07/27 | Euro | 369.698,68 | 0,36% |
| O. INTL CONSOLIDATED AIRLINES 3,75 03/29 | Euro | 101.510,85 | 0,10% |
| O. ISLANDSBANKI 1,125 VAR 01/24 | Euro | 305.854,19 | 0,30% |
| O. ITALGAS SPA 0 02/28 | Euro | 194.844,00 | 0,19% |
| O. JDE PEETS NV 0,5 01/29 | Euro | 99.391,55 | 0,10% |
| O. JUNTA DE CASTILLA Y LEON 0,425 04/30 | Euro | 199.674,58 | 0,20% |
| O. KINGDOM OF MOROCCO 1,5 11/31 | Euro | 95.010,67 | 0,09% |
| O. LANDSBANKIN HF 1 05/23 | Euro | 1.018.626,71 | 1,00% |
| O. LEONARDO SPA 2,375 01/26 | Euro | 211.480,38 | 0,21% |
| O. LOUIS DREYFUS CO BV 1,625 04/28 | Euro | 202.797,86 | 0,20% |
| O. MEDIABANCA DI CRED FIN 1,125 07/25 | Euro | 419.211,40 | 0,41% |
| O. MERCIALYS SA 4,625 07/27 | Euro | 740.423,84 | 0,73% |
| O. MERLIN PROPERTIES 2,375 05/22 | Euro | 407.643,07 | 0,40% |
| O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,375 06/30 | Euro | 298.614,04 | 0,29% |
| O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,875 12/34 | Euro | 703.182,41 | 0,69% |
| O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 2,375 07/27 | Euro | 557.714,59 | 0,55% |

(expressat en euros)

| Classe de Valor | Divisa | Efectiu | % s/Total Cartera |
|---|-----------------|-----------------------|-------------------|
| A. LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITT | Euro | 426.538,50 | 0,42% |
| A. MERCK KGAA | Euro | 189.350,70 | 0,19% |
| A. MTU AERO ENGINES AG | Euro | 110.925,90 | 0,11% |
| A. NBI BEARINGS EUROPE SA | Euro | 16.954,80 | 0,02% |
| A. PRYSMIAN SPA | Euro | 119.892,18 | 0,12% |
| A. RED ELECTRICA CORPORACION SA | Euro | 190.991,00 | 0,19% |
| A. REPSOL SA | Euro | 133.275,91 | 0,13% |
| A. RWE AG | Euro | 140.178,72 | 0,14% |
| A. S.O.I.T.E.C. | Euro | 195.938,60 | 0,19% |
| A. SAF-HOLLAND SE | Euro | 48.820,26 | 0,05% |
| A. SANOFI SA | Euro | 236.893,16 | 0,23% |
| A. SAP SE | Euro | 170.297,72 | 0,17% |
| A. SCHNEIDER ELECTRIC SA | Euro | 137.854,52 | 0,14% |
| A. SIEMENS AG-REG (GR) | Euro | 108.232,20 | 0,11% |
| A. STELLANTIS NV -FP | Euro | 40.010,26 | 0,04% |
| A. STMICROELECTRONICS NV (IM) | Euro | 206.889,80 | 0,20% |
| A. STORA ENSO OYJ-R SHS | Euro | 75.186,50 | 0,07% |
| A. TOTALENERGIES SE | Euro | 645.429,98 | 0,63% |
| A. UNILEVER PLC | Euro | 338.051,52 | 0,33% |
| A. VALEO SA | Euro | 139.392,04 | 0,14% |
| A. VEOLIA ENVIRONNEMENT | Euro | 64.439,10 | 0,06% |
| A. WORLDLINE SA | Euro | 120.225,62 | 0,12% |
| TOTAL: Renda Variable Euro | | 9.868.286,31 | 9,70% |
| A. AAK AB | Corona Sueca | 210.948,03 | 0,21% |
| A. AKER BP ASA | Corona Noruega | 230.006,94 | 0,23% |
| A. DSV A/S | Corona Danesa | 208.476,22 | 0,20% |
| A. GIVAUDAN-REG | Franco Suizo | 141.245,34 | 0,14% |
| A. LANCASHIRE HOLDINGS LTD | Libra Esterlina | 51.124,44 | 0,05% |
| A. LUNDIN MINING CORP | Corona Sueca | 68.040,60 | 0,07% |
| A. NESTLE SA - REG | Franco Suizo | 478.958,34 | 0,47% |
| A. RECKITT BENCKISER GROUP PLC | Libra Esterlina | 93.804,66 | 0,09% |
| A. ROCHE HOLDING AG | Franco Suizo | 369.928,97 | 0,36% |
| A. SIKA AG-REG | Franco Suizo | 270.579,36 | 0,27% |
| A. SOFTWAREONE HOLDING AG | Franco Suizo | 92.860,46 | 0,09% |
| A. TRELLEBORG AB-B SHS | Corona Sueca | 148.742,27 | 0,15% |
| A. ZURICH INSURANCE GROUP AG | Franco Suizo | 224.737,90 | 0,22% |
| TOTAL: Renda Variable No Euro | | 2.589.453,53 | 2,55% |
| TOTAL: Renda Variable | | 12.457.739,84 | 12,25% |
| TOTAL CARTERA (**) | | 101.697.555,06 | 100,00% |
| CARTERA INSTRUMENTS DERIVATS (*) | | | |
| *F. EURO FX CURR FUT SEP21 | Dólar USA | 3.164.232,44 | |
| TOTAL: Futurs No Euro | | 3.164.232,44 | |
| TOTAL: Futurs | | 3.164.232,44 | |
| *O.P. EURO STOXX50 3900 DIC21 (V) | Euro | 72.036,00 | |
| TOTAL: Opcions Euro | | 72.036,00 | |
| TOTAL: Opcions | | 72.036,00 | |
| TOTAL DERIVADOS: | | 3.236.268,44 | |

(*) Instruments Derivats amb signe negatiu impliquen que són operacions de venda.
(**) La diferència entre patrimoni i total cartera són la liquiditat, els deutors i els creditors.

El Fons de Pensiones en el qual està integrat el Pla, ha realitzat determinades operacions catalogades com vinculades per l'article 85 ter del RD 304/204 pel qual s'aprova el Reglament de Plans y Fons de Pensiones. Referent a això, el departament de Control Intern de la gestora ha verificat que les operacions s'han realitzat en interès exclusiu del Fons i a preus i condicions iguals o millors que els de mercat, de conformitat amb el que estableix el Reglament Intern de Conducta i en la Política d'operacions vinculades de Mediolanum Pensiones, S.G.F.P., S.A.