

Cyclops, Plan de Pensiones

Nº de Registro D.G.S.: N0240

DATOS PRINCIPALES

Nombre del plan:	Cyclops, Plan de Pensiones
Nombre del fondo:	Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones
Categoría:	RENTA FIJA MIXTA INTERNACIONAL
Asset Allocation:	70% Renta Fija y menos del 30% Renta Variable
Fecha de inicio:	23/10/2002
Valor de la participación:	2.380,34 € (30/09/2022)
Principal divisa:	EUR
Grado de riesgo:	Medio
Duración:	2,53
Volatilidad:	4,82%
Patrimonio:	26.632,89 € (30/09/2022)
Patrimonio anterior informe:	27.257,15 € (30/06/2022)
Participaciones:	11,19 (30/09/2022)
Participaciones anterior informe:	11,19 (30/06/2022)

POLÍTICA DE INVERSIÓN

El Plan de Pensiones invierte en un fondo de pensiones con vocación de renta fija mixta (con hasta un 30% de la inversión en valores de renta variable). La inversión es global, invirtiendo mayoritariamente en deuda pública y bonos corporativos europeos con una calificación crediticia adecuada. El Fondo de Pensiones invierte en compañías con un nivel de riesgo de insolvencia muy bajo. La elección de los valores se realiza tras un detallado análisis de la evolución de los resultados y otros parámetros de las compañías, así como de la situación macroeconómica del país. El plazo mínimo para invertir en este Fondo de Pensiones está alrededor de los 5 años de duración puesto que las inversiones conllevan para el inversor un riesgo elevado a corto plazo.

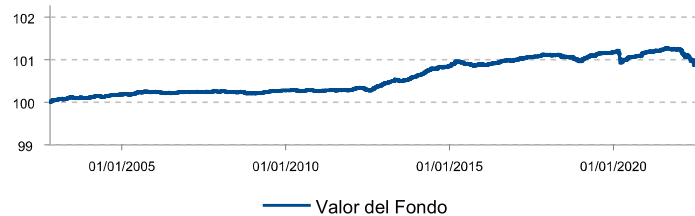
DATOS GENERALES DEL PLAN

Gestora:	MEDIOLANUM PENSIONES, S.A., S.G.F.P.
Depositario:	BANCO MEDIOLANUM, S.A.
Promotor:	BANCO MEDIOLANUM, S.A.
Entidad encargada de la gestión del patrimonio:	TREA ASSET MANAGEMENT SGIIC, S.A.

HISTÓRICO

30/09/2022	€ 2.380,34
31/08/2022	€ 2.475,04
31/07/2022	€ 2.521,10
30/06/2022	€ 2.436,19
31/05/2022	€ 2.537,45
30/04/2022	€ 2.573,19
31/03/2022	€ 2.634,97
28/02/2022	€ 2.644,02
31/01/2022	€ 2.719,43
31/12/2021	€ 2.757,21
30/11/2021	€ 2.743,40
31/10/2021	€ 2.754,65

Evolución Valor Liquidativo de la Unidad de Cuenta



Rentabilidad media anual (T.A.E.)

2022*	2021	3 años	5 años	10 años	15 años	20 años
-13,67%	2,27%	3,10%	1,60%	3,56%	2,54%	1,91%

Rentabilidad últimos 5 años

2022*	2021	2020	2019	2018**
-13,67%	2,27%	0,23%	6,90%	-4,70%

* Rentabilidad acumulada hasta el último mes natural finalizado

** En estos años se produjeron modificaciones significativas en la política de inversión

Rentabilidades pasadas no son garantía de rentabilidades futuras.

Volatilidad

Últimos 12 meses



Régimen de aportaciones y contingencias generales cubiertas

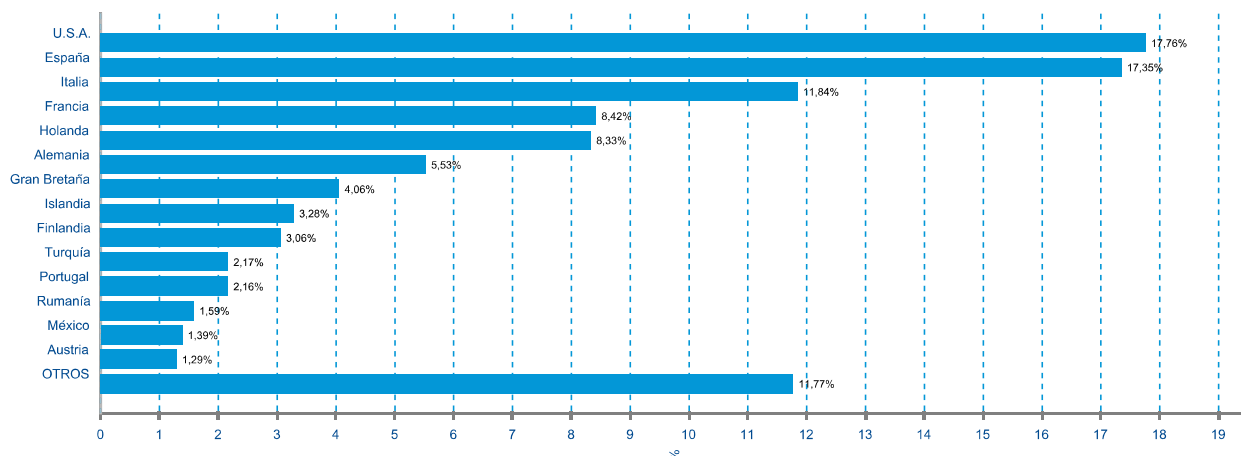
Aportación mínima:	10 Euros/año
Aportación máxima:	Según el máximo legal establecido
Contingencias cubiertas por el fondo:	-Jubilación -Incapacidad. -Fallecimiento -Dependencia

Gastos desde inicio de año

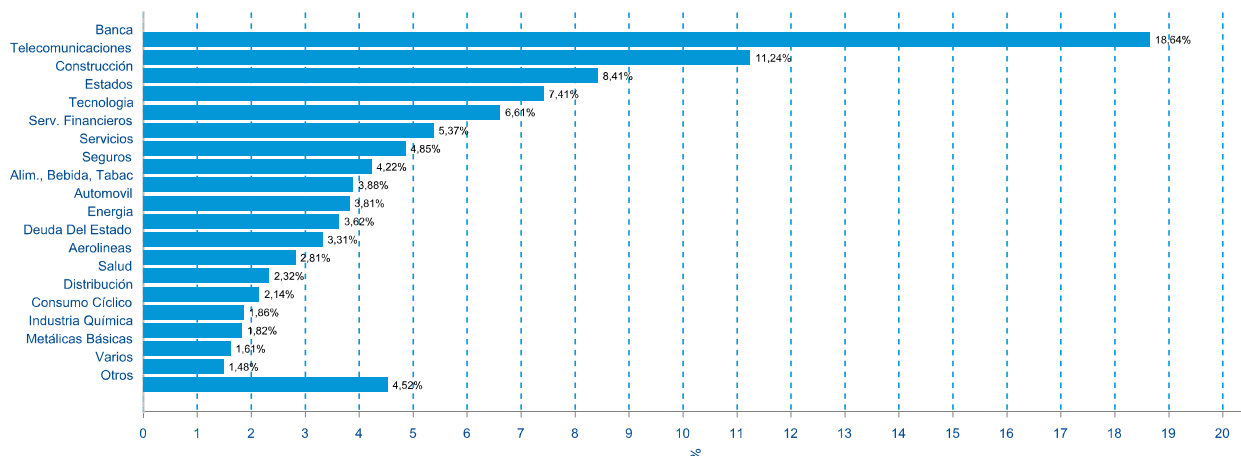
	Importe	% Cuenta Posición
Gastos:	313,60 €	1,09%
Comisión de Gestión:	271,25 €	0,94%
Comisión Depositario:	41,73 €	0,15%
Servicios Exteriores:	0,58 €	0,00%
Notarios:	0,00 €	0,00%
Asesores:	0,03 €	0,00%
Otros Gastos:	0,00 €	0,00%

Modificaciones estatutarias y/o reglamentarias

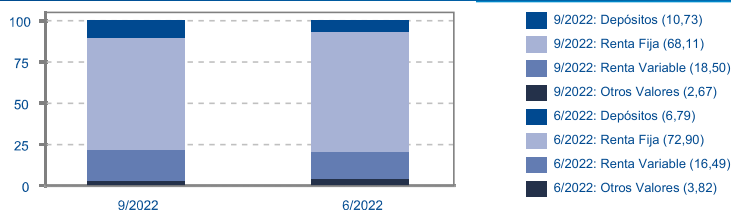
COMPOSICIÓN GEOGRÁFICA SOBRE CARTERA



COMPOSICIÓN SECTORIAL SOBRE CARTERA



Composición de la cartera (%)



Evolución de los Mercados Financieros

El empeoramiento de las perspectivas de crecimiento unido a los mensajes de los bancos centrales priorizando estabilizar la inflación respecto al crecimiento explican los movimientos en los precios de los activos en el trimestre. En la segunda mitad del trimestre, las sorpresas al alza de la inflación y los bancos centrales elevando los niveles a los que esperan subir los tipos, provocaron las caídas de final de trimestre. El mercado está asumiendo que la desaceleración económica no es suficiente para parar la inflación y los bancos centrales están dispuestos a asumir "daños colaterales" hasta alcanzar su objetivo. El endurecimiento de las políticas monetarias por parte de los principales bancos centrales junto al alza de los precios de la energía ha supuesto que las economías, cuya fuente de crecimiento eran las exportaciones, hayan visto un deterioro importante en sus cuentas provocando una fuerte depreciación de sus divisas en el trimestre, obligando a subidas de tipos para compensar la depreciación. La pérdida de impulso macro y el entorno de creciente incertidumbre durante el trimestre no se ha visto reflejado en bajadas en las estimaciones de beneficios (sólo en los sectores más ligados al consumo). Los sectores más sensibles han sido los más castigados: inmobiliario, comercio al por menor y tecnología. Los activos de renta fija han sufrido nuevamente las mayores pérdidas, acumulando las peores rentabilidades registradas nunca reflejando la agresividad y rapidez de las subidas de tipos de los bancos centrales a nivel global.

Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composición de la Cartera a fecha 30/09/2022

(expresado en euros)

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
CARTERA DE VALORES			
B. ACCIONA FINANCIACION FIL 1,20 01/25	Euro	93.487,59	0,09%
B. ACS SERVICIOS 1,875 04/26		461.702,33	0,45%
B. ARCELORMITTAL 1 05/23	Euro	198.273,73	0,19%
B. ARCELORMITTAL SA 4,875 09/26	Euro	98.797,78	0,10%
B. ARION BANKI HF 0,375 07/25	Euro	603.072,15	0,59%
B. ARION BANKI HF 0,625 05/24	Euro	554.612,79	0,54%
B. BANCO BPM SPA 0,875 07/26	Euro	169.761,97	0,17%
B. BANCO BPM SPA 1,625 02/25	Euro	460.033,56	0,45%
B. BANCO BPM SPA 1,75 01/25	Euro	235.746,13	0,23%
B. BANCO DE SABADELL 1,75 05/24	Euro	672.555,88	0,66%
B. BANCO DE SABADELL SA 2,625 VAR 03/26	Euro	94.043,63	0,09%
B. BANCO DE SABADELL SA 5,375 VAR 09/26	Euro	296.024,10	0,29%
B. BANK OF IRELAND 1,375 08/23	Euro	491.711,58	0,48%
B. BANK OF IRELAND GROUP VAR 06/26	Euro	186.118,33	0,18%
B. BERRY GLOBAL INC 1 01/25	Euro	274.055,87	0,27%
B. BPER BANCA 3,375 VAR 06/25	Euro	196.063,62	0,19%
B. CAIXA GERAL DE DEPOSITOS 1,25 11/24	Euro	285.937,93	0,28%
B. CAIXABANK SA 0,625 10/24	Euro	659.939,00	0,65%
B. CELLNEX FINANCE CO SA 0,75 11/26	Euro	83.904,53	0,08%
B. CEPESA FINANCE SA 0,75 02/28	Euro	81.994,66	0,08%
B. CETIN GROUP BV 3,125 04/27	Euro	90.170,48	0,09%
B. CIE DE PHALSBOURG 5 03/24	Euro	386.781,37	0,38%
B. CRL CREDITO AGRIC MUT 2,5 VAR 11/26	Euro	267.570,82	0,26%
B. CTP BV 2,125 10/25	Euro	364.864,00	0,36%
B. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 1,625 11/23	Euro	195.600,41	0,19%
B. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2 07/24	Euro	377.815,51	0,37%
B. ESPIRITO SANTO 5,25 06/15	Euro	1.950,00	0,00%
B. FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 3,375 07/23	Euro	101.086,21	0,10%
B. FIN IMMOBILIERE BORDELA1 6,00 01/25	Euro	461.819,29	0,45%
B. FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1,514 02/23	Euro	100.088,44	0,10%
B. HEIMSTADEN AB 4,25 03/26	Euro	391.648,61	0,38%
B. HEIMSTADEN BOSTAD AB 2,125 09/23	Euro	195.388,74	0,19%
B. HOLDING DINFRASTRUCTURE 0,625 03/23	Euro	198.193,84	0,19%
B. IBERCAJA BANCO SA 3,75 VAR 06/25	Euro	197.961,18	0,19%
B. ILIAD SA 0,75 02/24	Euro	284.657,14	0,28%
B. IMMOBILIARE GRANDE DIST 2,125 11/24	Euro	1.867.246,58	1,83%
B. INTL CONSOLIDATED AIRLIN 0,50 07/23	Euro	95.089,92	0,09%
B. INTL CONSOLIDATED AIRLIN 2,75 03/25	Euro	682.140,05	0,67%
B. ISLANDSBANKI 0,5 11/23	Euro	193.101,01	0,19%
B. LANDSBANKINN HF 0,375 05/25	Euro	176.449,18	0,17%
B. LANDSBANKINN HF 0,50 05/24	Euro	833.549,05	0,82%
B. LAR ESPANA REAL ESTATE 1,75 07/26	Euro	565.231,88	0,55%
B. LOUIS DREYFUS CO BV 2,375 11/25	Euro	385.940,44	0,38%
B. MCC SPA 1,5 10/24	Euro	194.778,96	0,19%
B. MADIOBANCA DI CRED FIN ESC 01/24	Euro	313.854,95	0,31%
B. MOTA ENGIL SGPS SA 4,375 10/24	Euro	100.016,07	0,10%
B. NEINOR HOMES SLU 4,5 10/26	Euro	432.260,00	0,42%
B. NH HOTEL GROUP SA 4 07/26	Euro	353.976,52	0,35%
B. NOKIA OYJ 2,375 05/25	Euro	95.180,45	0,09%
B. NOS SGPS 1,125 05/23	Euro	497.122,47	0,49%
B. ONTEX GROUP NV 3,5 07/26	Euro	160.297,70	0,16%
B. PCF GMBH 4,75 04/26	Euro	748.532,50	0,73%
B. PETROLEOS MEXICANOS 2,5 11/22	Euro	101.878,14	0,10%
B. PIRELLI & C SPA 1,375 01/23	Euro	100.915,01	0,10%
B. POSCO 0,5 01/24	Euro	288.318,16	0,28%
B. PPF TELECOM GROUP BV 3,5 05/24	Euro	989.279,32	0,97%
B. RCI BANQUE SA 0,75 04/23	Euro	196.189,36	0,19%

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
O. MERCIALYS SA 2,5 02/29	Euro	241.306,81	0,24%
O. MERCIALYS SA 4,625 07/27	Euro	282.014,18	0,28%
O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,375 06/30	Euro	226.108,77	0,22%
O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,75 05/25	Euro	94.361,70	0,09%
O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,875 12/34	Euro	206.619,70	0,20%
O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 2,375 07/27	Euro	451.757,74	0,44%
O. MOTA ENGIL SGPS 4 01/23	Euro	202.071,78	0,20%
O. NE PROPERTY BV 1,75 11/24	Euro	187.129,78	0,18%
O. NE PROPERTY BV 1,875 10/26	Euro	505.523,42	0,50%
O. NE PROPERTY BV 2 01/30	Euro	143.653,56	0,14%
O. NE PROPERTY BV 3,375 07/27	Euro	171.304,96	0,17%
O. NEMAK SAB DE CV 2,25 07/28	Euro	419.544,00	0,41%
O. NEW AREVA HOLDING 4,875 09/24	Euro	456.357,82	0,45%
O. NN GROUP NV 4,375 VAR 06/49	Euro	96.598,49	0,09%
O. NN GROUP NV VAR 04/44	Euro	894.466,23	0,88%
O. NOKIA OYJ 2 03/24	Euro	98.911,89	0,10%
O. NOKIA OYJ 2 03/26	Euro	110.979,17	0,11%
O. NORTH MACEDONIA 1,625 03/28	Euro	75.514,67	0,07%
O. NORTH MACEDONIA 2,75 01/25	Euro	185.245,53	0,18%
O. ORANO SA 2,75 03/28	Euro	265.744,77	0,26%
O. ORANO SA 3,125 03/23	Euro	304.573,56	0,30%
O. ORANO SA 3,375 04/26	Euro	190.285,40	0,19%
O. PARPUBLICA FRN 10/27	Euro	98.852,10	0,10%
O. PPF TELECOM GROUP BV 2,125 01/25	Euro	564.412,36	0,55%
O. RAIFFEISEN BANK INTL VAR 06/49	Euro	176.132,75	0,17%
O. RAIFFEISEN LB NIEDEROEST 5,875 11/23	Euro	634.551,21	0,62%
O. RCI BANQUE SA 1 05/23	Euro	198.188,68	0,19%
O. RCI BANQUE SA FRN 03/25	Euro	97.746,73	0,10%
O. REN FINANCE BV 1,75 06/23	Euro	199.691,86	0,20%
O. RENAULT SA 1 04/24	Euro	281.846,38	0,28%
O. ROADSTER FIN DAC 1,625 12/24	Euro	551.056,85	0,54%
O. ROMANIA 2,75 02/26	Euro	369.791,73	0,36%
O. ROMANIA 2,875 03/29	Euro	234.881,55	0,23%
O. ROMANIA 2,875 05/28	Euro	240.195,66	0,24%
O. SIGMA ALIMENTOS 2,625 02/24	Euro	394.665,04	0,39%
O. SUMMIT PROP 2,00 01/25	Euro	269.531,67	0,26%
O. TDF INFRASTRUCTURE SAS 2,5 04/26	Euro	182.354,66	0,18%
O. TELEFONAKTIEBOLAGET LM 1 05/29	Euro	72.462,68	0,07%
O. TELEFONICA EUROPE BV 2,625 VAR 06/49	Euro	99.010,25	0,10%
O. TELEFONICA EUROPE BV 3 VAR 12/49	Euro	195.839,95	0,19%
O. TELEFONICA EUROPE BV VAR 03/49	Euro	612.843,86	0,60%
O. TELEFONICA EUROPE VAR 03/49	Euro	194.502,49	0,19%
O. TEOLLISUUDEN VOIMA 2 05/24	Euro	488.310,00	0,48%
O. TEOLLISUUDEN VOIMA OYJ 1,125 03/26	Euro	892.009,32	0,87%
O. TEOLLISUUDEN VOIMA OYJ 1,375 06/28	Euro	724.929,41	0,71%
O. UNIBAIL-RODAMCO-WESTFLD VAR 10/49	Euro	1.078.347,29	1,06%
O. UNICREDIT SPA VAR 09/29	Euro	176.765,67	0,17%
O. UNIONE DI BANCHE ITALIAN 1,625 04/25	Euro	234.299,21	0,23%
O. UNIPOL GRUPPO SPA 3,25 09/30	Euro	343.988,93	0,34%
O. UNIPOL GRUPPO SPA 3,5 11/27	Euro	98.507,25	0,10%
O. UPJOHN FINANCE BV 1,362 06/27	Euro	85.249,15	0,08%
O. VALEO SA 1,5 06/25	Euro	278.782,52	0,27%
O. VIA OUTLETS BV 1,75 11/28	Euro	77.879,25	0,08%
O. VOLKSWAGEN INTL FIN NV VAR 12/49	Euro	304.489,81	0,30%
O. WEPA HYGIENPRODUKTE GMB 2,875 12/27	Euro	804.521,97	0,79%
O. WUESTENROT&WUERTEMTEMBERG VAR 09/41	Euro	135.788,52	0,13%
P. ENDESA 24/10/22	Euro	199.856,20	0,20%
TOTAL: Renta Fija Euro		68.663.468,05	67,27%

El Fondo de Pensiones en el que esta integrado el Plan, ha realizado determinadas operaciones catalogadas como vinculadas por el artículo 85 ter del RD 304/204, por el que se aprueba el Reglamento de Planes y Fondos de Pensiones. A este respecto, el departamento de Control Interno de la Gestora ha verificado que las operaciones se han realizado en interés exclusivo del Fondo y a precios y condiciones iguales o mejores que los de mercado, de conformidad con lo establecido en el Reglamento Interno de Conducta y en la Política de operaciones Vinculadas de Mediolanum Pensiones S.G.F.P., S.A.



Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composición de la Cartera a fecha 30/09/2022

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
B. RCS & RDS SA 2,50 02/25	Euro	353.535,56	0,35%
B. RENAULT SA 1 03/23	Euro	199.248,25	0,20%
B. REP. MACEDONIA 5,625 07/23	Euro	301.738,60	0,30%
B. SERVICIOS MEDIO AMBIENTE 0,815 12/23	Euro	195.332,19	0,19%
B. SERVICIOS MEDIO AMBIENTE 1,661 12/26	Euro	182.549,51	0,18%
B. SIG COMBIBLOC PURCHASER 2,125 06/25	Euro	279.108,56	0,27%
B. TELECOM ITALIA SPA 4 04/24	Euro	98.769,89	0,10%
B. UNICAJA BANCO SA 1 VAR 12/26	Euro	88.107,88	0,09%
B. UNIONE DI BANCHE ITALIA 2,625 04/24	Euro	491.038,77	0,48%
B. UNIONE DI BANCHE ITALIAN 1,75 04/23	Euro	200.649,32	0,20%
B. VGP NV 1,625 01/27	Euro	81.576,18	0,08%
B. VIA CELERE DESARROLLOS 5,25 04/26	Euro	91.349,00	0,09%
B. ZF FINANCE GMBH 3 09/25	Euro	266.889,58	0,26%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 01/49	Euro	161.178,43	0,16%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 01/29	Euro	409.775,56	0,40%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 04/30	Euro	186.675,62	0,18%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 09/27	Euro	164.941,01	0,16%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 10/48	Euro	189.547,24	0,19%
O. ARCELOMITTAL 1,75 11/25	Euro	373.324,27	0,37%
O. AROUNDTOWN SA 3,375 VAR 12/49	Euro	68.864,53	0,07%
O. AROUNDTOWN SA VAR 07/49	Euro	134.574,52	0,13%
O. ASSICURAZIONI GEN VAR 10/47-CALL 10/27	Euro	303.861,66	0,30%
O. ASSICURAZIONI GENERALI VAR 06/48	Euro	190.544,68	0,19%
O. ASSICURAZIONI VAR 12/42	Euro	213.434,47	0,21%
O. ATRADIUS VAR 09/44 (CALL 9/24)	Euro	977.920,68	0,96%
O. AUTOSTRADE PER LITALIA 1,75 06/26	Euro	352.664,27	0,35%
O. AUTOSTRADE PER LITALIA 2 12/28	Euro	79.314,32	0,08%
O. AUTOSTRADE PER LITALIA 4,375 09/25	Euro	195.675,59	0,19%
O. AUTOSTRADE PER LITALIA 5,875 06/24	Euro	104.095,93	0,10%
O. AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL 3,75 12/22	Euro	206.955,45	0,20%
O. BANCO COMERC PORTUGUES VAR 02/27	Euro	241.862,96	0,24%
O. BANCO COMERC PORTUGUES VAR 04/28	Euro	227.245,89	0,22%
O. BANCO DE SABADELL SA 1,125 03/25	Euro	546.002,71	0,53%
O. BANKIA SA 1,125 11/26	Euro	438.797,74	0,43%
O. BANKINTER SA 0,875 07/26	Euro	261.764,30	0,26%
O. BCO COM PORTUGUES VAR 12/27	Euro	276.578,92	0,27%
O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0,1 04/31	Euro	857.419,11	0,84%
O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0,5 10/31	Euro	319.843,62	0,31%
O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1,5 04/27	Euro	192.069,75	0,19%
O. BP CAPITAL MARKETS PLC VAR 06/49	Euro	631.206,21	0,62%
O. BULGARIAN ENERGY HLD 2,45 07/28	Euro	522.953,03	0,51%
O. BULGARIAN ENERGY HLD 3,5 06/25	Euro	632.547,71	0,62%
O. BUONI POLIENNALI DEL TES 0,9 04/31	Euro	76.905,00	0,08%
O. BUONI POLIENNALI DEL TES 1,65 12/30	Euro	1.414.315,00	1,39%
O. BUONI POLIENNALI DEL TES 6,5 11/27	Euro	116.025,45	0,11%
O. BUONI POLIENNALI DEL TES ESC 07/30	Euro	403.379,40	0,40%
O. CAIXABANK 1,125 01/23	Euro	402.494,14	0,39%
O. CAIXABANK SA VAR 06/49	Euro	185.291,58	0,18%
O. CARGILL INC 2,5 02/23	Euro	203.477,29	0,20%
O. CARMILA SA 1,625 05/27	Euro	160.186,11	0,16%
O. CEETRUS SA 2,75 11/26	Euro	783.738,74	0,77%
O. CELLNEX FINANCE CO SA 1 09/27	Euro	319.535,34	0,31%
O. CELLNEX TELECOM 2,875 04/25	Euro	194.171,07	0,19%
O. CELLNEX TELECOM SA 1,75 10/30	Euro	289.742,08	0,28%
O. COCA-COLA EUROPACIFIC 1,125 04/29	Euro	254.838,41	0,25%
O. COMUNIDAD AUTO CANARIAS 0,714 10/31	Euro	79.638,76	0,08%
O. COOPERATIEVE RABOBANK UA VAR 06/49	Euro	533.303,05	0,52%
O. COOPERATIEVE RABOBANK VAR 06/49	Euro	336.234,54	0,33%
O. CPI PROPERTY GROUP SA 1,75 01/30	Euro	70.613,58	0,07%

(expresado en euros)

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
B. AFRICAN EXPORT-IMPORT 5,25 10/23	Dólar USA	622.528,26	0,61%
B. MEDIUMBANC DI CRED FIN 2 09/23	Dólar USA	196.630,88	0,19%
B. TOWER BERSAMA INF 4,25 01/25	Dólar USA	194.463,15	0,19%
B. US TREASURY N/B 0,25 05/25	Dólar USA	183.480,64	0,18%
B. US TREASURY N/B 1,125 10/26	Dólar USA	454.099,01	0,44%
B. US TREASURY N/B 1,25 11/26	Dólar USA	637.644,04	0,62%
B. US TREASURY N/B 1,75 03/25	Dólar USA	480.187,42	0,47%
O. AFRICA FINANCE CORP 2,875 04/28	Dólar USA	168.481,48	0,17%
O. AFRICAN EXPORT-IMPORT 3,994 09/29	Dólar USA	260.055,94	0,25%
O. ANADOLU EFES BIR 3,375 06/28	Dólar USA	297.280,15	0,29%
O. AXTEL SAB 6,375 11/24	Dólar USA	299.408,46	0,29%
O. COCA-COLA ICECEK 4,215 09/24	Dólar USA	778.998,18	0,76%
O. COCA-COLA ICECEK AS 4,5 01/29	Dólar USA	168.762,50	0,17%
O. DNB BANK ASA 4,875 VAR 11/49	Dólar USA	585.246,63	0,57%
O. EASTERN & SOUTHER 4,125 06/28	Dólar USA	169.109,79	0,17%
O. GRUPO BIMBO 5,95 VAR 04/00	Dólar USA	203.995,22	0,20%
O. KOC HOLDING AS 5,25 03/23	Dólar USA	405.975,65	0,40%
O. LOUIS DREYFUS CO BV 5,25 06/23	Dólar USA	413.984,90	0,41%
O. MEDIUMBANC DI CRED FIN FRN 07/24	Dólar USA	101.796,46	0,10%
O. MEDIUMBANC INTL LUX SA 2 03/27	Dólar USA	101.088,96	0,10%
O. NBM US HOLDINGS INC 6,625 08/29	Dólar USA	189.098,46	0,19%
O. NOKIA OYJ 6,625 05/39	Dólar USA	97.205,45	0,10%
O. RUMO LUXEMBOURG SARL 4,2 01/32	Dólar USA	160.742,02	0,16%
O. STORA ENSO 7,25 04/36	Dólar USA	615.953,18	0,60%
O. TELEFONICA EMISIONES SAU 7,045 06/36	Dólar USA	309.305,79	0,30%
O. TURK SISE VE CAM FABRIKA 6,95 03/26	Dólar USA	188.812,89	0,18%
O. TURKCELL 5,75 10/25	Dólar USA	370.807,55	0,36%
O. UNICREDIT SPA FRN 05/23	Dólar USA	202.899,79	0,20%
O. UNICREDIT SPA VAR 06/32	Dólar USA	172.963,92	0,17%
O. US TREASURY N/B 0,5 04/27	Dólar USA	173.751,67	0,17%
O. US TREASURY N/B 0,625 05/30	Dólar USA	160.828,42	0,16%
O. US TREASURY N/B 0,625 08/30	Dólar USA	239.425,40	0,23%
O. US TREASURY N/B 1,25 06/28	Dólar USA	350.348,01	0,34%
O. US TREASURY N/B 1,375 10/28	Dólar USA	263.442,38	0,26%
O. US TREASURY N/B 1,75 08/41	Dólar USA	69.792,91	0,07%
O. US TREASURY N/B 2,375 05/29	Dólar USA	1.255.986,92	1,23%
TOTAL: Renta Fija No Euro		11.544.482,48	11,31%
TOTAL: Renta Fija		80.207.950,53	78,58%
A. AIR LIQUIDE SA	Euro	646.580,00	0,63%
A. AIRBUS SE (FP)	Euro	400.005,00	0,39%
A. AMADEUS IT GROUP SA	Euro	407.235,00	0,40%
A. AMUNDI SA	Euro	193.320,00	0,19%
A. CANCOM SE	Euro	1.461.600,00	1,43%
A. CIE AUTOMOTIVE SA	Euro	202.160,00	0,20%
A. DASSAULT AVIATION SA	Euro	386.100,00	0,38%
A. ENEL SPA	Euro	253.440,00	0,25%
A. FRESSENIUS SE & CO KGAA	Euro	186.575,00	0,18%
A. INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	Euro	306.432,00	0,30%
A. JENOPTIK AG	Euro	406.800,00	0,40%
A. KERING	Euro	320.985,00	0,31%
A. KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	Euro	235.215,00	0,23%
A. KONTRON AG	Euro	509.950,00	0,50%
A. LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITT	Euro	347.928,00	0,34%
A. MAIRE TECNIMONT SPA	Euro	435.240,00	0,43%
A. PROSUS NV	Euro	296.835,00	0,29%
A. SANOFI SA	Euro	180.320,00	0,18%
A. SAP SE	Euro	227.124,00	0,22%
TOTAL: Renta Variable Euro		7.403.844,00	7,25%
A. ALIBABA GROUP HOLDING LTD	Dólar H.K.	506.504,31	0,50%

El Fondo de Pensiones en el que esta integrado el Plan, ha realizado determinadas operaciones catalogadas como vinculadas por el artículo 85 ter del RD 304/204, por el que se aprueba el Reglamento de Planes y Fondos de Pensiones. A este respecto, el departamento de Control Interno de la Gestora ha verificado que las operaciones se han realizado en interés exclusivo del Fondo y a precios y condiciones iguales o mejores que los de mercado, de conformidad con lo establecido en el Reglamento Interno de Conducta y en la Política de operaciones Vinculadas de Mediolanum Pensiones S.G.F.P., S.A.



Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composición de la Cartera a fecha 30/09/2022

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
O. CPI PROPERTY GROUP SA 2,75 05/26	Euro	349.971,45	0,34%
O. CPI PROPERTY GROUP SA VAR 11/49	Euro	700.566,16	0,69%
O. CRITERIA CAIXA SA 1,5 05/23	Euro	99.888,78	0,10%
O. CROWN EURO HOLDINGS SA 2,625 09/24	Euro	95.660,25	0,09%
O. CTP NV 1,25 06/29	Euro	141.860,63	0,14%
O. DEUDA PUBLICA 0,70 04/32	Euro	239.845,03	0,23%
O. DEUDA PUBLICA 1,25 10/30	Euro	798.482,34	0,78%
O. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2,875 05/27	Euro	159.175,97	0,16%
O. DS SMITH PLC 0,875 09/26	Euro	170.621,10	0,17%
O. EASYJET FINCO BV 1,875 03/28	Euro	236.961,12	0,23%
O. EASYJET PLC 0,875 06/25	Euro	180.548,99	0,18%
O. EASYJET PLC 1,75 02/23	Euro	200.981,84	0,20%
O. ENEL SPA VAR 11/49	Euro	88.530,68	0,09%
O. ENI SPA VAR 2 05/49	Euro	157.595,12	0,15%
O. EUROFINS SCIENTIFIC 2,125 07/24	Euro	145.844,02	0,14%
O. EURONET WORLDWIDE INC 1,375 05/26	Euro	776.927,34	0,76%
O. EUTELSAT SA 2 10/25	Euro	93.815,52	0,09%
O. FCC AQUALIA SA 2,629 06/27	Euro	548.677,89	0,54%
O. FCE BANK 1,615 05/23	Euro	595.996,36	0,58%
O. FIDELIDADE CIA SEGUROS VAR 09/31	Euro	82.633,38	0,08%
O. GALP GAS NATURAL DISTRIB 1,375 09/23	Euro	98.043,21	0,10%
O. GAS NATURAL FENOSA VAR 11/49	Euro	305.296,60	0,30%
O. GENERAL MOTORS 0,955 09/23	Euro	487.423,97	0,48%
O. GESTAMP AUTOMOCION 3,25 04/26	Euro	1.075.994,33	1,05%
O. GLOBALWORTH REAL ESTATE 2,95 07/26	Euro	330.597,04	0,32%
O. GLOBALWORTH REAL ESTATE 3 03/25	Euro	89.185,77	0,09%
O. GRIFOLS SA 3,2 05/25	Euro	980.818,67	0,96%
O. HAMMERSON IRELAND 1,75 06/27	Euro	147.364,68	0,14%
O. HEIMSTADEN AB 4,375 03/27	Euro	378.894,10	0,37%
O. HEIMSTADEN BOSTA VAR 01/49	Euro	244.334,79	0,24%
O. HEIMSTADEN BOSTAD TRESRY 1,375 07/28	Euro	155.311,86	0,15%
O. ILIAD SA 1,5 10/24	Euro	94.951,58	0,09%
O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,625 10/28	Euro	82.241,96	0,08%
O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,75 04/31	Euro	295.500,38	0,29%
O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,875 07/26	Euro	89.344,64	0,09%
O. INTESA SANPAOLO SPA 6,625 09/23	Euro	205.255,42	0,20%
O. INTL CONSOLIDATED AIR 0,625 11/22	Euro	499.338,38	0,49%
O. INTL CONSOLIDATED AIRLINES 1,5 07/27	Euro	404.230,52	0,40%
O. INTL CONSOLIDATED AIRLINES 3,75 03/29	Euro	69.550,05	0,07%
O. ISLANDSBANKI 1,125 VAR 01/24	Euro	299.669,88	0,29%
O. LANDSBANKIN HF 1 05/23	Euro	690.499,08	0,68%
O. LEONARDO SPA 1,5 06/24	Euro	191.761,42	0,19%
O. LEONARDO SPA 2,375 01/26	Euro	282.158,47	0,28%
O. LEONARDO SPA 4,875 03/25	Euro	308.727,08	0,30%
O. MEDIOBANCA DI CRED FIN 0,75 VAR 11/28	Euro	197.519,97	0,19%
O. MEDIOBANCA DI CRED FIN 1,125 07/25	Euro	92.309,41	0,09%

(expresado en euros)

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
A. ALIGN TECHNOLOGY INC	Dólar USA	190.164,25	0,19%
A. ALPHABET INC-CL A	Dólar USA	1.170.985,51	1,15%
A. AMAZON.COM INC	Dólar USA	1.441.032,44	1,41%
A. APPLE INC	Dólar USA	676.759,84	0,66%
A. BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	Dólar USA	1.634.482,76	1,60%
A. BOEING CO	Dólar USA	395.282,60	0,39%
A. BOOKING HOLDINGS INC	Dólar USA	234.696,39	0,23%
A. CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD-USD	Dólar USA	340.338,71	0,33%
A. CHECK POINT SOFTWARE TECH	Dólar USA	445.702,92	0,44%
A. CONSTELLATION SOFTWARE INC	Dólar Canadá	460.728,88	0,45%
A. JD.COM INC - CL A	Dólar H.K.	193.569,77	0,19%
A. JSC KASPI.KZ GDR-REG	Dólar USA	295.857,99	0,29%
A. KROGER CO	Dólar USA	223.168,74	0,22%
A. MERCK & CO INC	Dólar USA	228.435,01	0,22%
A. META PLATFORMS INC CLASS A	Dólar USA	1.176.576,21	1,15%
A. MICRON TECHNOLOGY INC	Dólar USA	408.896,14	0,40%
A. MICROSOFT CORP	Dólar USA	879.136,91	0,86%
A. MOODYS CORP	Dólar USA	310.026,02	0,30%
A. ORACLE CORP	Dólar USA	417.434,20	0,41%
A. PALO ALTO NETWORKS INC	Dólar USA	471.217,91	0,46%
A. PAYPAL HOLDINGS INC	Dólar USA	421.481,33	0,41%
A. PINDUODUO INC-ADR	Dólar USA	140.457,05	0,14%
A. ROCHE HOLDING AG	Franco Suizo	701.945,93	0,69%
A. ROYALTY PHARMA PLC- CL A	Dólar USA	225.453,99	0,22%
A. S&P GLOBAL INC	Dólar USA	320.863,60	0,31%
A. THE COCA-COLA CO	Dólar USA	440.067,33	0,43%
A. VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	Dólar USA	102.958,58	0,10%
TOTAL: Renta Variable No Euro		14.454.225,32	14,16%
TOTAL: Renta Variable		21.858.069,32	21,42%
TOTAL CARTERA (**)		102.066.019,85	100,00%
CARTERA INSTRUMENTOS DERIVADOS (*)			
F. EURO-SCHATZ FUT DIC22	Euro	-7.501.550,00	
TOTAL: Futuros Euro		-7.501.550,00	
F. EURO FX CURR FUT DIC22	Dólar USA	10.579.668,13	
TOTAL: Futuros No Euro		10.579.668,13	
TOTAL: Futuros		3.078.118,13	
O.C. EUROSTOXX BANKS 140 MAR23 (C)	Euro	26.137,50	
O.P. EURO STOXX50 2950 DIC22 (V)	Euro	8.910,00	
O.P. EURO STOXX50 3550 DIC22 (C)	Euro	44.115,00	
TOTAL: Opciones Euro		79.162,50	
TOTAL: Opciones		79.162,50	
TOTAL DERIVADOS:		3.157.280,63	

(*) Instrumentos Derivados con signo negativo implican que son operación de venta.
(**) La diferencia entre patrimonio y total cartera son la liquidez, los deudores y los acreedores.

El Fondo de Pensiones en el que esta integrado el Plan, ha realizado determinadas operaciones catalogadas como vinculadas por el artículo 85 ter del RD 304/204, por el que se aprueba el Reglamento de Planes y Fondos de Pensiones. A este respecto, el departamento de Control Interno de la Gestora ha verificado que las operaciones se han realizado en interés exclusivo del Fondo y a precios y condiciones iguales o mejores que los de mercado, de conformidad con lo establecido en el Reglamento Interno de Conducta y en la Política de operaciones Vinculadas de Mediolanum Pensiones S.G.F.P., S.A.



Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composición de la Cartera a fecha 30/06/2022

(expresado en euros)

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
CARTERA DE VALORES			
*B. BANCO ESPIRITO SANTO 6,875 07/49	Euro	26.181,50	0,03%
*B. SA DE OBRAS SERVICIOS 6 07/22	Euro	427.875,67	0,41%
*O. ASTURIANA DE LAMINADOS 5,75 08/27	Euro	165.863,42	0,16%
*O. BANKIA SA VAR 6,00 PERP 07/49	Euro	405.239,12	0,39%
*O. BESPL SA 7,125 11/23	Euro	271,00	0,00%
*O. CELLNEX TELECOM 3,125 7/22	Euro	206.030,79	0,20%
*O. NATIONALE-NEDERLANDEN 9 VAR 08/42	Euro	433.468,82	0,41%
B. ACCIONA FINANCIACION FIL 1,20 01/25	Euro	95.331,03	0,09%
B. ACS SERVICIOS 1,875 04/26	Euro	473.989,32	0,45%
B. ARCELORMITTAL 1 05/23	Euro	198.239,62	0,19%
B. ARION BANKI HF 0,375 07/25	Euro	636.052,51	0,61%
B. ARION BANKI HF 0,625 05/24	Euro	572.777,59	0,55%
B. BANCO BPM SPA 0,875 07/26	Euro	178.250,88	0,17%
B. BANCO BPM SPA 1,625 02/25	Euro	709.890,92	0,68%
B. BANCO BPM SPA 1,75 01/25	Euro	239.643,39	0,23%
B. BANCO DE SABADELL 1,75 05/24	Euro	679.772,21	0,65%
B. BANCO DE SABADELL SA 2,625 VAR 03/26	Euro	95.724,99	0,09%
B. BANK OF IRELAND 1,375 08/23	Euro	401.622,96	0,38%
B. BANK OF IRELAND GROUP VAR 06/26	Euro	190.831,12	0,18%
B. BERRY GLOBAL INC 1 01/25	Euro	277.632,98	0,27%
B. BPER BANCA 3,375 VAR 06/25	Euro	197.318,25	0,19%
B. CAIXA GERAL DE DEPOSITOS 1,25 11/24	Euro	290.788,73	0,28%
B. CAIXABANK SA 0,625 10/24	Euro	669.063,26	0,64%
B. CELLNEX FINANCE CO SA 0,75 11/26	Euro	85.179,49	0,08%
B. CEPSA FINANCE SA 0,75 02/28	Euro	568.978,32	0,54%
B. CETIN GROUP BV 3,125 04/27	Euro	93.149,81	0,09%
B. CIE DE PHALSBURG 5 03/24	Euro	396.844,27	0,38%
B. CRL CREDITO AGRIC MUT 2,5 VAR 11/26	Euro	274.152,41	0,26%
B. CTP BV 2,125 10/25	Euro	360.565,53	0,34%
B. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 1,625 11/23	Euro	194.409,23	0,19%
B. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2 07/24	Euro	382.779,07	0,37%
B. ESPIRITO SANTO 5,25 06/15	Euro	1.950,00	0,00%
B. FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 3,375 07/23	Euro	104.632,52	0,10%
B. FIN IMMOBILIERE BORDELAI 6,00 01/25	Euro	464.135,65	0,44%
B. FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1,514 02/23	Euro	99.203,82	0,09%
B. HEIMSTADEN AB 4,25 03/26	Euro	423.506,11	0,40%
B. HEIMSTADEN BOSTAD AB 2,125 09/23	Euro	200.005,51	0,19%
B. IBERCAJA BANCO SA 3,75 VAR 06/25	Euro	198.958,77	0,19%
B. ILIAD SA 0,75 02/24	Euro	282.200,01	0,27%
B. IMMOBILIARE GRANDE DIST 2,125 11/24	Euro	1.855.594,25	1,77%
B. INTL CONSOLIDATED AIRLIN 0,50 07/23	Euro	94.356,89	0,09%
B. INTL CONSOLIDATED AIRLIN 2,75 03/25	Euro	686.458,85	0,66%
B. ISLANDSBANKI 0,5 11/23	Euro	196.170,96	0,19%
B. LANDSBANKINN HF 0,375 05/25	Euro	184.960,14	0,18%
B. LANDSBANKINN HF 0,50 05/24	Euro	857.731,81	0,82%
B. LAR ESPANA REAL ESTATE 1,75 07/26	Euro	626.901,21	0,60%
B. LOUIS DREYFUS CO BV 2,375 11/25	Euro	393.725,92	0,38%
B. MCC SPA 1,5 10/24	Euro	197.820,79	0,19%
B. MEDIOBANCA DI CRED FIN ESC 01/24	Euro	318.161,91	0,30%
B. MOTA ENGIL SGPS SA 4,375 10/24	Euro	198.486,64	0,19%
B. NEINOR HOMES SLU 4,5 10/26	Euro	412.255,00	0,39%
B. NH HOTEL GROUP SA 4 07/26	Euro	365.751,80	0,35%
B. NOKIA OYJ 2,375 05/25	Euro	96.816,82	0,09%
B. NOS SGPS 1,125 05/23	Euro	499.639,66	0,48%
B. ONTEX GROUP NV 3,5 07/26	Euro	163.555,28	0,16%
B. PCF GMBH 4,75 04/26	Euro	721.924,00	0,69%
B. PETROLEOS MEXICANOS 2,5 11/22	Euro	101.482,00	0,10%

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
O. MEDIOBANCA DI CRED FIN 0,75 VAR 11/28	Euro	207.904,86	0,20%
O. MEDIOBANCA DI CRED FIN 1,125 07/25	Euro	381.687,40	0,36%
O. MERCIALYS SA 2,5 02/29	Euro	252.316,40	0,24%
O. MERCIALYS SA 4,625 07/27	Euro	306.272,92	0,29%
O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,375 06/30	Euro	239.838,04	0,23%
O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,75 05/25	Euro	97.060,60	0,09%
O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 1,875 12/34	Euro	294.750,52	0,28%
O. MERLIN PROPERTIES SOCIMI 2,375 07/27	Euro	484.089,59	0,46%
O. MOTA ENGIL SGPS 4 01/23	Euro	203.569,56	0,19%
O. NE PROPERTY BV 1,75 11/24	Euro	188.413,59	0,18%
O. NE PROPERTY BV 1,875 10/26	Euro	512.527,81	0,49%
O. NE PROPERTY BV 2 01/30	Euro	144.577,34	0,14%
O. NE PROPERTY BV 3,375 07/27	Euro	179.383,59	0,17%
O. NEMAK SAB DE CV 2,25 07/28	Euro	444.563,26	0,43%
O. NESTLE FINANCE INTL LTD 0,375 12/40	Euro	121.987,51	0,12%
O. NEW AREVA HOLDING 4,875 09/24	Euro	472.041,37	0,45%
O. NN GROUP NV 4,375 VAR 06/49	Euro	98.281,75	0,09%
O. NN GROUP NV VAR 04/44	Euro	907.887,45	0,87%
O. NOKIA OYJ 2 03/24	Euro	198.867,56	0,19%
O. NOKIA OYJ 2 03/26	Euro	109.906,85	0,11%
O. NORTH MACEDONIA 1,625 03/28	Euro	151.872,16	0,15%
O. NORTH MACEDONIA 2,75 01/25	Euro	183.859,23	0,18%
O. ORANO SA 2,75 03/28	Euro	514.184,63	0,49%
O. ORANO SA 3,375 04/26	Euro	281.433,04	0,27%
O. PARPUBLICA FRN 10/27	Euro	97.519,28	0,09%
O. PPF TELECOM GROUP BV 2,125 01/25	Euro	562.944,66	0,54%
O. RAIFFEISEN BANK INTL VAR 06/49	Euro	162.745,52	0,16%
O. RAIFFEISEN LB NIEDEROEST 5,875 11/23	Euro	627.964,27	0,60%
O. RCI BANQUE SA 1 05/23	Euro	198.342,58	0,19%
O. RCI BANQUE SA FRN 03/25	Euro	97.977,90	0,09%
O. REN FINANCE BV 1,75 06/23	Euro	200.779,67	0,19%
O. RENAULT SA 1 04/24	Euro	281.537,22	0,27%
O. ROADSTER FIN DAC 1,625 12/24	Euro	529.105,32	0,51%
O. ROMANIA 2,75 02/26	Euro	381.195,12	0,36%
O. ROMANIA 2,875 03/29	Euro	252.807,58	0,24%
O. ROMANIA 2,875 05/28	Euro	258.427,68	0,25%
O. SIGMA ALIMENTOS 2,625 02/24	Euro	400.534,47	0,38%
O. SUMMIT PROP 2,00 01/25	Euro	259.880,67	0,25%
O. TDF INFRASTRUCTURE SAS 2,5 04/26	Euro	190.858,38	0,18%
O. TELECOM ITALIA SPA 1,625 01/29	Euro	73.715,14	0,07%
O. TELEFONAKTIEBOLAGET LM 1 05/29	Euro	75.762,63	0,07%
O. TELEFONICA EUROPE BV 2,625 VAR 06/49	Euro	98.321,60	0,09%
O. TELEFONICA EUROPE BV 3 VAR 12/49	Euro	196.849,62	0,19%
O. TELEFONICA EUROPE BV VAR 03/49	Euro	603.916,93	0,58%
O. TELEFONICA EUROPE VAR 03/49	Euro	193.627,01	0,19%
O. TEOLLISUUDEN VOIMA 2 05/24	Euro	492.179,45	0,47%
O. TEOLLISUUDEN VOIMA OYJ 1,125 03/26	Euro	910.293,70	0,87%
O. TEOLLISUUDEN VOIMA OYJ 1,375 06/28	Euro	753.985,23	0,72%
O. UNIBAIL-RODAMCO-WESTFLD VAR 10/49	Euro	910.591,89	0,87%
O. UNICREDIT SPA VAR 09/29	Euro	187.955,45	0,18%
O. UNIONE DI BANCHE ITALIAN 1,625 04/25	Euro	239.625,24	0,23%
O. UNIPOL GRUPPO SPA 3,25 09/30	Euro	377.700,22	0,36%
O. UNIPOL GRUPPO SPA 3,5 11/27	Euro	608.724,33	0,58%
O. UPJOHN FINANCE BV 1,362 06/27	Euro	87.037,85	0,08%
O. VALEO SA 1,5 06/25	Euro	276.637,27	0,26%
O. VIA OUTLETS BV 1,75 11/28	Euro	84.817,15	0,08%
O. VOLKSWAGEN INTL FIN NV VAR 12/49	Euro	300.396,16	0,29%
O. WEPA HYGIENEPRODUKTE GMB 2,875 12/27	Euro	845.621,51	0,81%

El Fondo de Pensiones en el que esta integrado el Plan, ha realizado determinadas operaciones catalogadas como vinculadas por el artículo 85 ter del RD 304/204, por el que se aprueba el Reglamento de Planes y Fondos de Pensiones. A este respecto, el departamento de Control Interno de la Gestora ha verificado que las operaciones se han realizado en interés exclusivo del Fondo y a precios y condiciones iguales o mejores que los de mercado, de conformidad con lo establecido en el Reglamento Interno de Conducta y en la Política de operaciones Vinculadas de Mediolanum Pensiones S.G.F.P., S.A.



Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composición de la Cartera a fecha 30/06/2022

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
B. PIRELLI & C SPA 1,375 01/23	Euro	100.669,44	0,10%
B. POSCO 0,5 01/24	Euro	294.852,08	0,28%
B. PPF TELECOM GROUP BV 3,5 05/24	Euro	989.507,40	0,95%
B. RCI BANQUE SA 0,75 04/23	Euro	196.496,18	0,19%
B. RCS & RDS SA 2,50 02/25	Euro	176.642,00	0,17%
B. RENAULT SA 1 03/23	Euro	198.720,14	0,19%
B. REP. MACEDONIA 5,625 07/23	Euro	318.464,18	0,30%
B. SERVICIOS MEDIO AMBIENTE 1,661 12/26	Euro	187.074,19	0,18%
B. SIG COMBIBLOC PURCHASER 2,125 06/25	Euro	286.868,61	0,27%
B. TELECOM ITALIA SPA 4 04/24	Euro	99.584,67	0,10%
B. UNICAJA BANCO SA 1 VAR 12/26	Euro	89.542,82	0,09%
B. UNIONE DI BANCHE ITALIA 2,625 04/24	Euro	498.450,55	0,48%
B. UNIONE DI BANCHE ITALIAN 1,75 04/23	Euro	201.085,12	0,19%
B. VGP NV 1,625 01/27	Euro	79.836,59	0,08%
B. VIA CELERE DESARROLLOS 5,25 04/26	Euro	87.663,50	0,08%
B. ZF FINANCE GMBH 3 09/25	Euro	271.119,08	0,26%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 01/49	Euro	173.719,63	0,17%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 01/29	Euro	410.368,22	0,39%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 04/30	Euro	189.382,11	0,18%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 09/27	Euro	171.892,96	0,16%
O. ABANCA CORP BANCARIA SA VAR 10/48	Euro	199.180,79	0,19%
O. ABERTIS INFRAESTRUCTURAS 2,25 03/29	Euro	181.098,90	0,17%
O. ARCELORMITTAL 1,75 11/25	Euro	381.295,89	0,36%
O. AROUNDTOWN SA 3,375 VAR 12/49	Euro	76.458,85	0,07%
O. AROUNDTOWN SA VAR 07/49	Euro	127.171,34	0,12%
O. ASSICURAZIONI GEN VAR 10/47-CALL 10/27	Euro	313.997,75	0,30%
O. ASSICURAZIONI GENERALI VAR 06/48	Euro	197.482,14	0,19%
O. ASSICURAZIONI VAR 12/42	Euro	213.095,62	0,20%
O. ATRADIUS VAR 09/44 (CALL 9/24)	Euro	1.039.557,81	0,99%
O. AUTOSTRADE PER LITALIA 1,75 06/26	Euro	363.475,89	0,35%
O. AUTOSTRADE PER LITALIA 2 12/28	Euro	83.337,21	0,08%
O. AUTOSTRADE PER LITALIA 4,375 09/25	Euro	207.882,11	0,20%
O. AUTOSTRADE PER LITALIA 5,875 06/24	Euro	105.106,11	0,10%
O. BANCO COMERC PORTUGUES VAR 02/27	Euro	252.997,27	0,24%
O. BANCO COMERC PORTUGUES VAR 04/28	Euro	241.702,60	0,23%
O. BANCO DE SABADELL SA 1,125 03/25	Euro	555.029,34	0,53%
O. BANCO DE SABADELL SA VAR 06/28	Euro	164.493,92	0,16%
O. BANKIA SA 1,125 11/26	Euro	455.424,93	0,44%
O. BANKIA SA VAR 6,375 PERP 09/49	Euro	198.961,76	0,19%
O. BANKINTER SA 0,875 07/26	Euro	274.290,66	0,26%
O. BCO COM PORTUGUES VAR 12/27	Euro	577.312,36	0,55%
O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0,1 04/31	Euro	912.240,85	0,87%
O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0,5 10/31	Euro	339.995,51	0,33%
O. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 1,5 04/27	Euro	199.055,59	0,19%
O. BP CAPITAL MARKETS PLC VAR 06/49	Euro	636.027,96	0,61%
O. BPER BANCA VAR 03/27	Euro	263.326,73	0,25%
O. BULGARIAN ENERGY HLD 2,45 07/28	Euro	589.393,29	0,56%
O. BULGARIAN ENERGY HLD 3,5 06/25	Euro	652.265,37	0,62%
O. BUONI POLIENNALI DEL TES 0,9 04/31	Euro	83.307,77	0,08%
O. BUONI POLIENNALI DEL TES 1,65 12/30	Euro	1.525.176,25	1,46%
O. BUONI POLIENNALI DEL TES 6,5 11/27	Euro	121.760,45	0,12%
O. BUONI POLIENNALI DEL TES ESC 07/30	Euro	444.913,50	0,43%
O. CAIXABANK SA VAR 06/49	Euro	193.846,33	0,19%
O. CARMILA SA 1,625 05/27	Euro	164.764,93	0,16%
O. CEETRUS SA 2,75 11/26	Euro	802.340,38	0,77%
O. CELLNEX FINANCE CO SA 1 09/27	Euro	320.755,12	0,31%
O. CELLNEX FINANCE CO SA 2 09/32	Euro	69.786,56	0,07%
O. CELLNEX TELECOM 2,875 04/25	Euro	195.721,75	0,19%
O. CELLNEX TELECOM SA 1,75 10/30	Euro	363.937,12	0,35%

(expresado en euros)

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
O. WUESTENROT&WUERTTEMBERG VAR 09/41	Euro	150.567,29	0,14%
TOTAL: Renta Fija Euro		73.251.672,42	70,04%
*O. MEDIOBANCA SPA 2,3 09/22	Dólar USA	679.588,53	0,65%
B. AFRICAN EXPORT-IMPORT 5,25 10/23	Dólar USA	580.725,30	0,56%
B. MEDIOBANCA DI CRED FIN 2 09/23	Dólar USA	187.940,63	0,18%
B. TOWER BERSAMA INF 4,25 01/25	Dólar USA	188.372,55	0,18%
B. US TREASURY N/B 0,25 05/25	Dólar USA	176.127,17	0,17%
B. US TREASURY N/B 1,125 10/26	Dólar USA	440.506,10	0,42%
B. US TREASURY N/B 1,25 11/26	Dólar USA	619.063,80	0,59%
O. AFRICA FINANCE CORP 2,875 04/28	Dólar USA	166.398,56	0,16%
O. AFRICAN EXPORT-IMPORT 3,994 09/29	Dólar USA	247.461,21	0,24%
O. ANADOLU EFES BIR 3,375 06/28	Dólar USA	267.007,82	0,26%
O. AXTEL SAB 6,375 11/24	Dólar USA	340.989,29	0,33%
O. COCA-COLA ICECEK 4,215 09/24	Dólar USA	732.302,56	0,70%
O. COCA-COLA ICECEK AS 4,5 01/29	Dólar USA	158.511,06	0,15%
O. DNB BANK ASA 4,875 VAR 11/49	Dólar USA	553.356,01	0,53%
O. EASTERN & SOUTHER 4,125 06/28	Dólar USA	157.574,32	0,15%
O. GRUPO BINBO 5,95 VAR 04/00	Dólar USA	191.529,10	0,18%
O. KOC HOLDING AS 5,25 03/23	Dólar USA	382.391,58	0,37%
O. LUIS DREYFUS CO BV 5,25 06/23	Dólar USA	383.386,11	0,37%
O. MEDIOBANCA DI CRED FIN FRN 07/24	Dólar USA	100.313,86	0,10%
O. MEDIOBANCA INTL LUX SA 2 03/27	Dólar USA	95.452,48	0,09%
O. NBM US HOLDINGS INC 6,625 08/29	Dólar USA	189.235,80	0,18%
O. NOKIA OYJ 6,625 05/39	Dólar USA	95.162,66	0,09%
O. PETROBRAS GLOBAL FINANCE 5,6 01/31	Dólar USA	273.962,87	0,26%
O. RUMO LUXEMBOURG SARL 4,2 01/32	Dólar USA	157.345,79	0,15%
O. STORA ENSO 7,25 04/36	Dólar USA	612.058,91	0,59%
O. TELEFONICA EMISIONES SAU 7,045 06/36	Dólar USA	324.111,78	0,31%
O. TURK SISE VE CAM FABRIKA 6,95 03/26	Dólar USA	174.076,11	0,17%
O. TURKCELL 5,75 10/25	Dólar USA	340.003,40	0,33%
O. UNICREDIT SPA FRN 05/23	Dólar USA	188.865,39	0,18%
O. UNICREDIT SPA VAR 06/32	Dólar USA	169.060,22	0,16%
O. US TREASURY N/B 0,5 04/27	Dólar USA	338.040,16	0,32%
O. US TREASURY N/B 0,625 05/30	Dólar USA	159.159,45	0,15%
O. US TREASURY N/B 0,625 08/30	Dólar USA	237.796,62	0,23%
O. US TREASURY N/B 1,25 06/28	Dólar USA	343.140,06	0,33%
O. US TREASURY N/B 1,375 10/28	Dólar USA	258.589,40	0,25%
O. US TREASURY N/B 2,375 05/29	Dólar USA	1.511.835,98	1,45%
TOTAL: Renta Fija No Euro		12.021.438,64	11,49%
TOTAL: Renta Fija		85.273.111,06	81,53%
A. AIR LIQUIDE SA	Euro	563.728,00	0,54%
A. AIRBUS SE (FP)	Euro	369.800,00	0,35%
A. AMADEUS IT GROUP SA	Euro	372.120,00	0,36%
A. AMUNDI SA	Euro	177.480,00	0,17%
A. CANCOM SE	Euro	321.000,00	0,31%
A. CIE AUTOMOTIVE SA	Euro	236.800,00	0,23%
A. DASSAULT AVIATION SA	Euro	446.700,00	0,43%
A. FRESENIUS SE & CO KGAA	Euro	177.070,30	0,17%
A. INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	Euro	323.850,00	0,31%
A. JENOPTIK AG	Euro	319.200,00	0,31%
A. KERING	Euro	343.070,00	0,33%
A. KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	Euro	198.880,00	0,19%
A. KONTRON AG	Euro	351.500,00	0,34%
A. LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITT	Euro	349.020,00	0,33%
A. MAIRE TECNIMONT SPA	Euro	438.400,00	0,42%
A. PROSUS NV	Euro	499.840,00	0,48%
A. SANOFI SA	Euro	192.680,00	0,18%
A. SAP SE	Euro	173.860,00	0,17%
TOTAL: Renta Variable Euro		5.854.998,30	5,60%

El Fondo de Pensiones en el que esta integrado el Plan, ha realizado determinadas operaciones catalogadas como vinculadas por el artículo 85 ter del RD 304/204, por el que se aprueba el Reglamento de Planes y Fondos de Pensiones. A este respecto, el departamento de Control Interno de la Gestora ha verificado que las operaciones se han realizado en interés exclusivo del Fondo y a precios y condiciones iguales o mejores que los de mercado, de conformidad con lo establecido en el Reglamento Interno de Conducta y en la Política de operaciones Vinculadas de Mediolanum Pensiones S.G.F.P., S.A.



Mediolanum Pensiones II, Fondo de Pensiones

Composición de la Cartera a fecha 30/06/2022

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
O. CEPSA FINANCE SA 2,25 02/26	Euro	196.421,37	0,19%
O. COCA-COLA EUROPACIFIC 1,125 04/29	Euro	263.995,73	0,25%
O. COMUNIDAD AUTO CANARIAS 0,714 10/31	Euro	85.161,79	0,08%
O. COOPERATIEVE RABOBANK UA VAR 06/49	Euro	737.658,19	0,71%
O. COOPERATIEVE RABOBANK VAR 06/49	Euro	352.919,63	0,34%
O. CPI PROPERTY GROUP SA 1,75 01/30	Euro	71.768,48	0,07%
O. CPI PROPERTY GROUP SA 2,75 05/26	Euro	358.122,85	0,34%
O. CPI PROPERTY GROUP SA VAR 11/49	Euro	620.868,49	0,59%
O. CROWN EURO HOLDINGS SA 2,625 09/24	Euro	288.408,75	0,28%
O. CTP NV 1,25 06/29	Euro	140.228,49	0,13%
O. DEUDA PUBLICA 0,70 04/32	Euro	255.764,71	0,24%
O. DEUDA PUBLICA 1,25 10/30	Euro	845.488,73	0,81%
O. DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2,875 05/27	Euro	159.274,66	0,15%
O. DS SMITH PLC 0,875 09/26	Euro	181.172,00	0,17%
O. EASYJET FINCO BV 1,875 03/28	Euro	244.870,32	0,23%
O. EASYJET PLC 0,875 06/25	Euro	182.763,89	0,17%
O. EASYJET PLC 1,75 02/23	Euro	199.799,64	0,19%
O. ENEL SPA VAR 11/49	Euro	89.989,00	0,09%
O. ENI SPA VAR 2 05/49	Euro	163.106,90	0,16%
O. EUROFINS SCIENTIFIC 2,125 07/24	Euro	151.169,85	0,14%
O. EURONET WORLDWIDE INC 1,375 05/26	Euro	790.323,16	0,76%
O. EUTELSAT SA 2 10/25	Euro	98.587,41	0,09%
O. FCC AQUALIA SA 2,629 06/27	Euro	568.659,98	0,54%
O. FCE BANK 1,615 05/23	Euro	496.478,29	0,47%
O. FIDELIDADE CIA SEGUROS VAR 09/31	Euro	191.438,30	0,18%
O. GALP GAS NATURAL DISTRIB 1,375 09/23	Euro	100.054,63	0,10%
O. GAS NATURAL FENOSA VAR 11/49	Euro	304.376,42	0,29%
O. GENERAL MOTORS 0,955 09/23	Euro	198.778,16	0,19%
O. GESTAMP AUTOMOCION 3,25 04/26	Euro	1.065.320,33	1,02%
O. GLOBALWORTH REAL ESTATE 2,95 07/26	Euro	333.038,79	0,32%
O. GRIFOLS SA 3,2 05/25	Euro	1.099.912,00	1,05%
O. HAMMERSON IRELAND 1,75 06/27	Euro	151.954,49	0,15%
O. HEIMSTADEN AB 4,375 03/27	Euro	407.652,85	0,39%
O. HEIMSTADEN BOSTA VAR 01/49	Euro	210.118,14	0,20%
O. HEIMSTADEN BOSTAD TRESRY 1,375 07/28	Euro	154.708,41	0,15%
O. ILIAD SA 1,5 10/24	Euro	94.420,49	0,09%
O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,625 10/28	Euro	258.445,11	0,25%
O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,75 04/31	Euro	318.052,00	0,30%
O. INFRASTRUTTURE WIRELESS 1,875 07/26	Euro	94.405,04	0,09%
O. INTESA SANPAOLO SPA 6,625 09/23	Euro	218.135,70	0,21%
O. INTL CONSOLIDATED AIR 0,625 11/22	Euro	494.627,13	0,47%
O. INTL CONSOLIDATED AIRLINES 1,5 07/27	Euro	418.384,03	0,40%
O. INTL CONSOLIDATED AIRLINES 3,75 03/29	Euro	72.155,85	0,07%
O. ISLANDSBANKI 1,125 VAR 01/24	Euro	300.568,19	0,29%
O. LANDSBANKIN HF 1 05/23	Euro	692.948,70	0,66%
O. LEONARDO SPA 1,5 06/24	Euro	194.329,26	0,19%
O. LEONARDO SPA 2,375 01/26	Euro	289.020,58	0,28%
O. LEONARDO SPA 4,875 03/25	Euro	313.389,78	0,30%

(expresado en euros)

Clase de Valor	Divisa	Efectivo	% s/Total Cartera
**A. ALPHABET INC-CL A	Dólar USA	1.247.191,91	1,19%
*A. PALO ALTO NETWORKS INC	Dólar USA	471.136,97	0,45%
A. ALIBABA GROUP HOLDING LTD	Dólar H.K.	544.148,22	0,52%
A. ALIGN TECHNOLOGY INC	Dólar USA	112.872,00	0,11%
A. AMAZON.COM INC	Dólar USA	1.215.681,04	1,16%
A. APPLE INC	Dólar USA	521.632,96	0,50%
A. BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	Dólar USA	1.302.079,36	1,24%
A. BOEING CO	Dólar USA	430.347,20	0,41%
A. BOOKING HOLDINGS INC	Dólar USA	166.824,69	0,16%
A. CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD-USD	Dólar USA	333.078,98	0,32%
A. CHECK POINT SOFTWARE TECH	Dólar USA	464.631,82	0,44%
A. CONSTELLATION SOFTWARE INC	Dólar Canadá	424.760,49	0,41%
A. GOLAR LNG LTD	Dólar USA	216.997,33	0,21%
A. INTERNATIONAL PETROLEUM CORP	Corona Sueca	232.969,23	0,22%
A. JD.COM INC - CL A	Dólar H.K.	184.397,68	0,18%
A. JSC KASPI.KZ GDR-REG	Dólar USA	199.637,54	0,19%
A. KROGER CO	Dólar USA	180.579,93	0,17%
A. MERCK & CO INC	Dólar USA	217.402,71	0,21%
A. META PLATFORMS INC CLASS A	Dólar USA	1.076.640,60	1,03%
A. MICROSOFT CORP	Dólar USA	734.919,88	0,70%
A. MOODYS CORP	Dólar USA	259.414,35	0,25%
A. ORACLE CORP	Dólar USA	399.866,46	0,38%
A. PAYPAL HOLDINGS INC	Dólar USA	266.463,18	0,25%
A. PINDUODUO INC-ADR	Dólar USA	129.683,33	0,12%
A. ROCHE HOLDING AG	Franco Suizo	636.387,25	0,61%
A. ROYALTY PHARMA PLC- CL A	Dólar USA	240.595,19	0,23%
A. S&P GLOBAL INC	Dólar USA	321.499,43	0,31%
A. SAMSUNG ELECTRONICS-GDR REG S	Dólar USA	364.221,67	0,35%
A. THE COCA-COLA CO	Dólar USA	420.040,06	0,40%
A. VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	Dólar USA	141.501,34	0,14%
TOTAL: Renta Variable No Euro		13.457.602,80	12,87%
TOTAL: Renta Variable		19.312.601,10	18,47%
TOTAL CARTERA (**)		104.585.712,16	100,00%
CARTERA INSTRUMENTOS DERIVADOS (*)			
*F. EURO-SCHATZ FUT SEP22	Euro	-9.059.035,00	
TOTAL: Futuros Euro		-9.059.035,00	
*F. EURO FX CURR FUT SEP22	Dólar USA	13.483.895,08	
TOTAL: Futuros No Euro		13.483.895,08	
TOTAL: Futuros		4.424.860,08	
*O.C. EUROSTOXX BANKS 140 SEP22 (C)	Euro	16.400,00	
*O.P. EURO STOXX50 2900 SEP22 (V)	Euro	5.775,00	
*O.P. EURO STOXX50 3500 SEP22 (C)	Euro	28.890,00	
TOTAL: Opciones Euro		51.065,00	
TOTAL: Opciones		51.065,00	
TOTAL DERIVADOS:		4.475.925,08	

(*) Instrumentos Derivados con signo negativo implican que son operación de venta.
(**) La diferencia entre patrimonio y total cartera son la liquidez, los deudores y los acreedores.

El Fondo de Pensiones en el que esta integrado el Plan, ha realizado determinadas operaciones catalogadas como vinculadas por el artículo 85 ter del RD 304/204, por el que se aprueba el Reglamento de Planes y Fondos de Pensiones. A este respecto, el departamento de Control Interno de la Gestora ha verificado que las operaciones se han realizado en interés exclusivo del Fondo y a precios y condiciones iguales o mejores que los de mercado, de conformidad con lo establecido en el Reglamento Interno de Conducta y en la Política de operaciones Vinculadas de Mediolanum Pensiones S.G.F.P., S.A.

