

ANEXO A LA CONVOCATORIA DE LA ASAMBLEA GENERAL ORDINARIA DE MUTUALISTAS, CONVOCADA PARA EL DIA 12 DE MARZO DE 2018

Punto Segundo (2.6) del Orden del Día de la Convocatoria

Propuesta de aprobación de:

Punto 2.6 El Informe anual acerca del Grado de Cumplimiento del Código de las Inversiones Financieras Temporales

El presente informe ha sido formulado y aprobado por el Consejo de Administración de Pelayo Mutua de Seguros y Reaseguros a Prima, en su reunión del día 8 de febrero de 2018.

Madrid, 9 de Febrero de 2018
Fdo: Francisco Hernando Díaz-Ambrona
Secretario del Consejo de Administración

INFORME ANUAL ACERCA DEL GRADO DE CUMPLIMIENTO DEL CÓDIGO DE LAS INVERSIONES FINANCIERAS TEMPORALES

I

Pelayo Mutua de Seguros y Reaseguros a Prima Fija (en adelante " La Mutua") ha cumplido durante el ejercicio cerrado a 31 de diciembre de 2017 con el Código de Conducta en materia de inversiones financieras temporales aprobado por acuerdo de la Comisión de Inversiones y del Consejo de Administración, ambos de fecha 18 de marzo de 2004, con la finalidad de dar cumplimiento a la siguiente normativa sobre inversiones financieras temporales promulgada por el Ministerio de Economía, el Banco de España y la Comisión Nacional del Mercado de Valores:

(i) Orden ECO/3721/2003, de 23 de diciembre, por la que se aprueba el Código de Conducta para las Mutuas de Seguros y Mutualidades de Previsión Social en materia de inversiones financieras temporales;

(ii) Resolución de 19 de diciembre de 2003, por la que se hace público el acuerdo del Consejo de Gobierno del Banco de España, en relación al Código de Conducta de las entidades sin ánimo de lucro para la realización de inversiones financieras temporales;

(iii) Acuerdo de 20 de noviembre de 2003, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, por el que se aprueba el Código de Conducta de las entidades sin ánimo de lucro para la realización de inversiones temporales.

II

A los efectos del citado Código se entenderá por inversiones financieras temporales las (i) inversiones realizadas con un plazo de vencimiento inferior al año, así como (ii) la parte de las inversiones a largo plazo con vencimiento inferior al año o aquellas (iii) inversiones a largo plazo que incluyan una opción o un derecho de resolución que puedan ejercitarse por cualquiera de las partes en el plazo de un año.

III

El Consejo de Administración al objeto de mantener la total transparencia informativa en esta materia sobre las inversiones financieras temporales manifiesta que:

- La gestión de las inversiones de la Mutua se ha realizado por profesionales con la experiencia, competencia e independencia necesarias y han contado con los medios técnicos adecuados para el desarrollo de su labor.

- Las inversiones a que se refiere este Código de Conducta, han seguido los criterios de seguridad, diversificación, liquidez y rentabilidad recogidos en la Política de Gestión del Riesgo de Inversión, Liquidez, Activos y Pasivos (ALM) que la Comisión de Inversiones y el Consejo de Administración de la Mutua revisa periódicamente al menos una vez al año.

- Las políticas de inversión aprobadas por el Consejo de Administración garantizan un equilibrio proporcionado entre seguridad, liquidez y rentabilidad, encontrándose dentro de los límites de riesgo, solvencia y diversificación recogidos en la normativa en vigor.

- Todas las inversiones de inversiones temporales realizadas se han materializado en activos a nombre de la Mutua con libre disposición en todo momento sobre los bienes y derechos adquiridos.
- No se han realizado operaciones por cuenta propia pero a nombre de terceros, así como tampoco operaciones en nombre propio por cuenta de terceros.
- La Mutua ha diversificado los riesgos correspondientes a las inversiones, realizando las mismas en valores o instrumentos financieros negociados en mercados oficiales, restringiendo la inversión en activos negociados en mercados no oficiales.
- No se han realizado operaciones con carácter especulativo, ni en activos emitidos en paraísos fiscales.
- La Mutua no ha realizado operaciones con derivados con carácter especulativo.

Madrid, 9 de Febrero de 2018
Fdo: Francisco Hernando Díaz-Ambrona
Secretario del Consejo de Administración