

INFORME PROVISIONAL Y ESTADOS FINANCIEROS NO AUDITADOS
SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE
30 DE SEPTIEMBRE DE 2019

THREADNEEDLE (LUX)

SICAV
un organismo luxemburgués
de inversión colectiva
en valores mobiliarios
de conformidad con la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010,
en su versión modificada.
Sociedad registrada en Luxemburgo con el número B-50.216

Contenido

Información de la Sociedad	4	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	44
Informes de auditoría de la Shariah	5	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	46
Estados financieros:		Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	48
Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)	7	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	49
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	8	Threadneedle (Lux) - European Select	51
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	9	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	53
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	11	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	54
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	12	Threadneedle (Lux) - Global Technology	55
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	14	Threadneedle (Lux) - UK Equities	56
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	15	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	58
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	16	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	60
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	17	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	61
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	18	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	62
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	19	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	64
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	20	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	66
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	21	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	67
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	22	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	69
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	23	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	70
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	24	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	71
Threadneedle (Lux) - Global Focus	26	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	73
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	27	Estados de cuentas de la Cartera:	
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	28	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	74
Threadneedle (Lux) - Global Select	30	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	80
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	31	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	85
Threadneedle (Lux) - American	32	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	92
Threadneedle (Lux) - American Select	34	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	96
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	36	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	101
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	37	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	108
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	38	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	112
Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	39	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	117
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	40	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	122
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	42	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	131
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	43		

Contenido

(continuación)

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	134	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	200
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	135	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	201
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	138	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	202
Threadneedle (Lux) - Global Focus	146	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	204
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	148	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	205
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	151	Notas a los Estados Financieros	207
Threadneedle (Lux) - Global Select	153	Información de los accionistas	311
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	155	Información para inversores en Suiza	312
Threadneedle (Lux) - American	157	Regulación de la transacción de financiación de valores	313
Threadneedle (Lux) - American Select	158	Directorio	315
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	159		
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	160		
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	162		
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	164		
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	165		
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	167		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	169		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	171		
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	172		
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	174		
Threadneedle (Lux) - European Select	176		
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	177		
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	179		
Threadneedle (Lux) - Global Technology	181		
Threadneedle (Lux) - UK Equities	183		
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	184		
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	185		
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	186		
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	187		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	193		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	199		

*Consulte la nota 1.

Este informe es una traducción de la versión original en inglés. En caso de ambigüedad, la versión en inglés prevalecerá en la medida en que lo permita la ley aplicable.

Información de la Sociedad

Sociedad

Threadneedle (Lux)
Sociedad registrada en Luxembourg B-50.216

Domicilio social

31 Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Gran Ducado de Luxemburgo

Sociedad Gestora

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Consejo de Administración

Jon Allen
Director Ejecutivo de Asia y el Pacífico
Columbia Threadneedle Investments
Singapur

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini
Consejera independiente
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Claude Kremer
Consejero independiente
Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Michelle Scrimgeour (renunció al Consejo de Administración el
26 de abril de 2019)
Consejera Delegada, EMEA
Columbia Threadneedle Investments
Londres
Reino Unido

Julie Griffiths (fue nombrada por el Consejo de Administración el
12 de abril de 2019)
Consejera de Riesgos, EMEA y Asia-Pacífico
Columbia Threadneedle Investments
Londres
Reino Unido



GATEHOUSE BANK



Informes de auditoría de la Shariah

Los Consejeros
Sociedad Gestora
74, Mühlenweg
L-2155 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo,

Estimados Señores:

As-salaamu Alaikum

De conformidad con un Acuerdo de Asesoramiento de la Shariah con fecha del 30 de marzo de 2017 entre Threadneedle Management Luxembourg S.A., en calidad de sociedad gestora de Threadneedle (Lux) (respectivamente, la **Sociedad Gestora** y la **SICAV**), y Gatehouse Bank Plc (el **Asesor de la Shariah**) en relación con Threadneedle (Lux) – Gatehouse Shariah Global Equity (el «**Subfondo de la Shariah**»), tenemos la obligación de presentar el presente Informe de Auditoría de la Shariah.

Los términos definidos en el Acuerdo de Asesoramiento de la Shariah tienen el mismo significado cuando se utilizan en el presente documento.

Hemos llevado a cabo una auditoría de la Shariah que incluía el examen de las Inversiones realizadas durante el periodo comprendido entre el **1 de abril de 2019 y el 30 de junio de 2019** por el Subfondo de la Shariah (la «**Auditoría de la Shariah**»). También hemos consultado y presentado nuestras conclusiones al Consejo de Supervisión de la Shariah, que confirmó que las inversiones y el cálculo de la cantidad de purificación se ajustan a las directrices y parámetros acordados de la Shariah.

Tras la auditoría de la Shariah, el Asesor de la Shariah aconseja al Subfondo de la Shariah que purifique 180,77 dólares estadounidenses en relación con los dividendos durante el periodo mencionado y que realice una donación a una organización benéfica que se acordará con el Consejo de Supervisión de la Shariah. No se espera que el Subfondo de la Shariah purifique las ganancias de capital durante dicho periodo.

Y Alá lo sabe mejor que nadie.

Fecha: 8 de septiembre de 2019

Firmado por y en nombre del Asesor de la Shariah

Abdirahman Sh. Osman Ali

GATEHOUSE BANK PLC | 14 GROSVENOR STREET | LONDRES | W1K 4PS
T +44 (0) 20 7070 6000 W www.gatehousebank.com



Informes de auditoría de la Shariah

Los Consejeros
Sociedad Gestora
74, Mühlenweg
L-2155 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo,

Estimados Señores:

As-salaamu Alaikum

De conformidad con un Acuerdo de Asesoramiento de la Shariah con fecha del 30 de marzo de 2017 entre Threadneedle Management Luxembourg S.A., en calidad de sociedad gestora de Threadneedle (Lux) (respectivamente, la **Sociedad Gestora** y la **SICAV**), y Gatehouse Bank Plc (el **Asesor de la Shariah**) en relación con Threadneedle (Lux) – Gatehouse Shariah Global Equity (el «**Subfondo de la Shariah**»), tenemos la obligación de presentar el presente Informe de Auditoría de la Shariah.

Los términos definidos en el Acuerdo de Asesoramiento de la Shariah tienen el mismo significado cuando se utilizan en el presente documento.

Hemos llevado a cabo una auditoría de la Shariah que incluía el examen de las Inversiones realizadas durante el periodo comprendido entre el **1 de julio de 2019 y el 30 de septiembre de 2019** por el Subfondo de la Shariah (la «**Auditoría de la Shariah**»). También hemos consultado y presentado nuestras conclusiones al Consejo de Supervisión de la Shariah, que confirmó que las inversiones y el cálculo de la cantidad de purificación se ajustan a las directrices y parámetros acordados de la Shariah.

Tras la auditoría de la Shariah, el Asesor de la Shariah aconseja al Subfondo de la Shariah que purifique 209,32 dólares estadounidenses en relación con los dividendos durante el periodo mencionado y que realice una donación a una organización benéfica que se acordará con el Consejo de Supervisión de la Shariah. No se espera que el Subfondo de la Shariah purifique las ganancias de capital durante dicho periodo.

Y Alá lo sabe mejor que nadie.

Fecha: 28 de octubre de 2019

Firmado por y en nombre del Asesor de la Shariah

Abdirahman Sh. Osman Ali

GATEHOUSE BANK PLC | 14 GROSVENOR STREET | LONDRES | W1K 4PS
T +44 (0) 20 7070 6000 W www.gatehousebank.com

Estados financieros agregados de Threadneedle (Lux)

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2, 18	16.000.324.446
Opciones compradas al valor de mercado	2, 12	964.500
Efectivo en el banco	2	226.515.596
Depósitos a plazo	2, 19	232.513.111
Por cobrar para la venta de inversiones		68.866.219
Suscripciones por cobrar		32.740.751
Reembolsos de comisiones de gestión de activos por cobrar	2	70.642
Interés por cobrar en swaps	2	1.325.658
Intereses y dividendos por cobrar, neto		48.849.816
Pago por adelantado abonado en transacciones swap	2	2.485.107
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	1.933.086
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	5.784.681
Ganancia neta no realizada en futuros	2, 12	799.400
Otros activos		10.640.472
Total de activos		16.633.813.485
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(3.285.114)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(205.188)
Pagadero por inversiones adquiridas		(109.994.368)
Reembolsos pagaderos		(49.421.805)
Interés pagadero en swaps	2	(4.736.931)
Dividendo pagadero en swaps	2	(490.864)
Pago por adelantado cobrado en transacciones swap	2	(1.418.437)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(23.119.092)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(32.295.362)
(Pérdida) neta no realizada en futuros	2, 12	(495.887)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(13.204.747)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(763.324)
Impuesto sobre la ganancia de capital no realizado sobre la inversión		(2.211.317)
Otros pasivos		(2.477.990)
Total de pasivos		(244.120.426)
Total de patrimonio neto		16.389.693.059

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		16.714.710.010
Ingreso		
Dividendos, neto	2	145.056.552
Interés sobre bonos, neto	2	74.751.749
Interés bancario	2	2.876.828
Ingresos por intereses en swaps		2.291.354
Ingresos por intereses en futuros		130.895
Reembolsos de comisiones de gestión de activos	2	140.287
Otros ingresos		187.609
Total de ingresos		225.435.274
Gastos		
Comisión de gestión de activos	5	(82.493.127)
Comisiones de rendimiento	8	(435.863)
Comisiones bancarias		(407.362)
Dividendos pagados en swaps		(2.003.100)
Gastos por intereses en swaps		(13.729.393)
Gastos por intereses en futuros		(377.854)
Otros gastos operativos	5	(14.737.802)
Comisiones varias	4	(29.651)
Total de gastos		(114.214.152)
Ingresos netos de inversiones		111.221.122
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		315.332.276
(Pérdida) neta realizada en swaps		(22.174.990)
(Pérdida) neta realizada en opciones		(4.251.239)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(53.395.865)
(Pérdida) neta realizada en futuros		(57.335.818)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.514.238)
(Pérdida) neta realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(7.813)
(Pérdida) neta realizada en reembolso de impuestos		(900)
Ganancia neta realizada		176.651.413
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		347.273.791
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		7.905.123
Cambio en la ganancia neta no realizada sobre opciones		815.840
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(10.846.529)
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		16.667.352
Cambio en la (pérdida) neta no realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(1.174.506)
Cambio neto en ganancia no realizada		360.641.071
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		648.513.606
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		3.354.375.350
Reembolsos de acciones		(3.985.803.625)
Dividendos	7	(31.414.995)
Total de movimientos de capital		(662.843.270)
Diferencias de cambio	2	(298.825.984)
Cambio en las inversiones cruzadas en las Carteras	18	(11.861.303)
Patrimonio neto al final del periodo		16.389.693.059

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	08 de mayo de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH [#]	—	13,00 ¹	13,80 ¹
Clase AU [#]	—	24,84	25,56
Clase DEC [#]	—	7,60 ¹	8,40 ¹
Clase DEH [#]	—	10,13 ¹	10,81 ¹
Clase DU [#]	—	26,93	27,82
Clase W [#]	—	53,51	54,96

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es USD.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 08 de mayo de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		2.899.620
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	5.576
Interés bancario	2	424
Total de ingresos		6.000
Gastos		
Comisión de gestión de activos	5	(2.893)
Comisiones bancarias		(6)
Gastos por intereses en futuros		(207)
Otros gastos operativos	5	(861)
Total de gastos		(3.967)
Ingresos netos de inversiones		2.033
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		27.353
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(33.297)
Ganancia neta realizada en futuros		8.957
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		453
Ganancia neta realizada		3.466
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(24.826)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		20.542
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(16.657)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(20.941)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones Valor Liquidativo Total		(15.442)
Movimientos de capital		
Reembolsos de acciones		(2.884.110)
Dividendos	7	(68)
Total de movimientos de capital		(2.884.178)
Patrimonio neto al final del periodo		—

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	08 de mayo de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	—	2.899.620	17.837.206

*Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	210.639.791
Efectivo en el banco	2	6.825.470
Por cobrar para la venta de inversiones		2.028.936
Suscripciones por cobrar		436.921
Interés por cobrar en swaps	2	999
Intereses y dividendos por cobrar, neto		1.703.996
Pago por adelantado abonado en transacciones swap	2	681.534
Ganancia neta no realizada en futuros	2, 12	5.186
Total de activos		222.322.833
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(589.240)
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.328.236)
Reembolsos pagaderos		(13.968)
Interés pagadero en swaps	2	(20.154)
Pago por adelantado cobrado en transacciones swap	2	(40.531)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.885.134)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(700.626)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(43.855)
Otros pasivos		(27.064)
Total de pasivos		(5.648.808)
Total de patrimonio neto		216.674.025

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	84.353,903
Clase AEH	16.125,079
Clase AKH	163,000
Clase AU	54.777,842
Clase AUP	7.308,851
Clase DEC	100,000
Clase DEH	8.666,842
Clase DU	25.266,176
Clase DUP	100,000
Clase IEC	100,000
Clase IEH	581.739,239
Clase IEP	100,000
Clase IGC	100,000
Clase IGH	3.856.692,096
Clase IKH	163,000
Clase IU	176.250,000
Clase IUP	100,000
Clase NEC	100,000
Clase NEH	33.011,495
Clase NGC	1.294.472,722
Clase NGH	666.885,855
Clase NU	2.413.838,044
Clase NUP	100,000
Clase XGH	6.820.960,436
Clase ZEH	40.070,342
Clase ZGH	25.099,527
Clase ZU	334.397,030

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el período contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		185.075.332
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	3.038.258
Interés bancario	2	61.747
Ingresos por intereses en swaps		35.091
Ingresos por intereses en futuros		21.855
Total de ingresos		3.156.951
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(340.997)
Comisiones bancarias		(14.898)
Gastos por intereses en swaps		(374.154)
Gastos por intereses en futuros		(7.101)
Otros gastos operativos	5	(154.808)
Total de gastos		(891.958)
Ingresos netos de inversiones		2.264.993
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		2.273.491
(Pérdida) neta realizada en swaps		(491.206)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(5.780.178)
(Pérdida) neta realizada en futuros		(2.041.732)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(393.335)
(Pérdida) neta realizada		(6.432.960)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		6.529.520
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		252.125
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		449.968
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		411.420
Cambio neto en ganancia no realizada		7.643.033
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		3.475.066
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		110.493.002
Reembolsos de acciones		(82.148.584)
Dividendos	7	(220.791)
Total de movimientos de capital		28.123.627
Patrimonio neto al final del periodo		216.674.025

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	216.674.025	185.075.332	143.415.226

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEC	10,6783 ¹	10,26 ¹	10,48 ¹
Clase AEH	11,4071 ¹	10,81 ¹	10,69 ¹
Clase AKH	114,0423 ²	107,96 ²	106,71 ²
Clase AU	12,5374	11,71	11,24
Clase AUP	11,8260	11,22	10,99
Clase DEC	9,8842 ¹	9,56 ¹	9,87 ¹
Clase DEH	11,0821 ¹	10,54 ¹	10,50 ¹
Clase DU	11,0880	10,40	10,05
Clase DUP	10,6893	10,18	10,11
Clase IEC	10,4559 ¹	10,06 ¹	—
Clase IEH	11,6728 ¹	11,06 ¹	10,92 ¹
Clase IEP	11,7810 ¹	10,84 ¹	—
Clase IGC	10,6081 ³	10,15 ³	—
Clase IGH	12,2723 ³	11,55 ³	11,27 ³
Clase IKH	116,4273 ²	110,17 ²	108,80 ²
Clase IU	12,8115	11,95	11,45
Clase IUP	10,9244	10,34	—
Clase NEC	10,4957 ¹	10,08 ¹	—
Clase NEH	10,5668 ¹	10,00 ¹	9,85 ¹
Clase NGC	10,3116 ³	9,84 ³	9,84 ³
Clase NGH	10,7708 ³	10,13 ³	9,86 ³
Clase NU	11,0990	10,34	9,88
Clase NUP	10,9708	10,38	—
Clase XGH [#]	10,5581 ³	—	—
Clase ZEH	10,6921 ¹	10,13 ¹	9,99 ¹
Clase ZGH	12,2163 ³	11,50 ³	11,21 ³
Clase ZU	12,7737	11,91	11,40

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

²La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es USD.

³La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	134.332.774
Efectivo en el banco	2	2.101.376
Suscripciones por cobrar		30.599
Intereses y dividendos por cobrar, neto		904.033
Ganancia neta no realizada en futuros	2, 12	31.891
Otros activos		8.395
Total de activos		137.409.068
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.549.570)
Reembolsos pagaderos		(247)
Interés pagadero en swaps	2	(11.611)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(66.247)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(942.144)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(44.775)
Otros pasivos		(11.231)
Total de pasivos		(2.625.825)
Total de patrimonio neto		134.783.243

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	6.689,764
Clase IE	925.976,269
Clase ZE	100,000
Clase 1E	7.558.637,103
Clase 1G	246.155,581
Clase 2E	6.779.946,643
Clase 2G	100,000
Clase 3G	1.054.979,987
Clase 4G	2.910.334,724
Clase 8E	2.528.268,004
Clase 8G	130.062,845
Clase 9G	100,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019
Clase AE	10,5449	10,19
Clase IE	10,6054	10,22
Clase ZE	10,5944	10,22
Clase 1E	1,4380	1,39
Clase 1G	1,1709 ¹	1,10 ¹
Clase 2E	10,6119	10,23
Clase 2G	10,4492 ¹	9,81 ¹
Clase 3G	1,3024 ¹	1,22 ¹
Clase 4G [#]	10,7797 ¹	—
Clase 8E	1,7796	1,72
Clase 8G	1,5761 ¹	1,48 ¹
Clase 9G	10,4420 ¹	9,81 ¹

¹La Clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el período contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		125.657.326
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	1.110.471
Interés bancario	2	748
Ingresos por intereses en swaps		6.194
Ingresos por intereses en futuros		3.220
Otros ingresos		720
Total de ingresos		1.121.353
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(306.777)
Comisiones bancarias		(5.660)
Gastos por intereses en swaps		(196.667)
Gastos por intereses en futuros		(1.192)
Otros gastos operativos	5	(67.416)
Comisiones varias	4	(4)
Total de gastos		(577.716)
Ingresos netos de inversiones		543.637
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.823.611
Ganancia neta realizada en swaps		219.932
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		25.489
(Pérdida) neta realizada en futuros		(883.079)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(6.093)
Ganancia neta realizada		1.179.860
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		3.273.621
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(284.732)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(80.651)
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		232.770
Cambio neto en ganancia no realizada		3.141.008
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		4.864.505
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		42.784.052
Reembolsos de acciones		(38.522.640)
Total de movimientos de capital		4.261.412
Patrimonio neto al final del periodo		134.783.243

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
EUR	134.783.243	125.657.326

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	472.867.529
Efectivo en el banco	2	6.548.125
Depósitos a plazo	2, 19	7.497.300
Suscripciones por cobrar		131.882
Intereses y dividendos por cobrar, neto		6.620.920
Ganancia neta no realizada en futuros	2, 12	5.652
Total de activos		493.671.408
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(3.055.164)
Reembolsos pagaderos		(2.708.969)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(469.532)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(399.996)
Otros pasivos		(64.794)
Total de pasivos		(6.698.455)
Total de patrimonio neto		486.972.953

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	143.967,174
Clase IEP	100,000
Clase XE	100,000
Clase ZE	27.950,000
Clase ZEP	100,000
Clase 1E	28.994.826,588
Clase 1EP	1.101.559,381
Clase 1G	380.678,766
Clase 1GP	89.197,461
Clase 1UT	395.670,256
Clase 2E	52.838,675
Clase 2EP	100,000
Clase 2FH	13.851,346
Clase 2G	175,971
Clase 2GP	100,000
Clase 3E	1.738.853,743
Clase 3EP	1.113.245,864
Clase 3FC	13.083,825
Clase 3FH	64.810,068
Clase 3G	1.336.296,249
Clase 3GP	93.144,796
Clase 4E	161.932,265
Clase 4G	100,000
Clase 4GP	1.910.650,409
Clase 8E	2.305.012,313
Clase 8EP	5.581.133,654
Clase 8FH	8.377,550
Clase 8G	25.043,218
Clase 8GP	5.275,145
Clase 9E	659.158,862
Clase 9EP	18.215,055
Clase 9FC	12.240,092
Clase 9FH	2.323,914
Clase 9G	100,000
Clase 9GP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		542.502.367
Ingreso		
Dividendos, neto	2	4.308
Interés sobre bonos, neto	2	10.733.874
Interés bancario	2	10.252
Total de ingresos		10.748.434
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.532.235)
Comisiones bancarias		(14.469)
Gastos por intereses en futuros		(4.232)
Otros gastos operativos	5	(410.163)
Total de gastos		(2.961.099)
Ingresos netos de inversiones		7.787.335
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(932.208)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		2.644.865
(Pérdida) neta realizada en futuros		(520.993)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(179.555)
Ganancia neta realizada		1.012.109
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		7.737.006
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(1.207.855)
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		147.231
Cambio neto en ganancia no realizada		6.676.382
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		15.475.826
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		38.081.176
Reembolsos de acciones		(109.004.147)
Dividendos	7	(82.269)
Total de movimientos de capital		(71.005.240)
Patrimonio neto al final del periodo		486.972.953

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
EUR	486.972.953	542.502.367

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019
Clase IE	10,5289	10,20
Clase IEP	10,2447	9,93
Clase XE [#]	10,0880	—
Clase ZE	10,5191	10,19
Clase ZEP	10,2431	9,93
Clase 1E	10,4686	10,16
Clase 1EP	10,2017	9,90
Clase 1G	10,2931 ¹	9,73 ¹
Clase 1GP	10,0531 ¹	9,51 ¹
Clase 1UT	10,3263 ²	10,09 ²
Clase 2E	10,5316	10,20
Clase 2EP	10,2700	9,94
Clase 2FH	10,4783 ³	10,17 ³
Clase 2G	10,3616 ¹	9,77 ¹
Clase 2GP	10,0987 ¹	9,52 ¹
Clase 3E	10,5400	10,20
Clase 3EP	10,3366	10,00
Clase 3FC	10,2260 ³	9,92 ³
Clase 3FH	10,4833 ³	10,17 ³
Clase 3G	10,3625 ¹	9,77 ¹
Clase 3GP	10,0399 ¹	9,47 ¹
Clase 4E	10,6191	10,24
Clase 4G	10,6781 ¹	10,03 ¹
Clase 4GP	10,2113 ¹	9,59 ¹
Clase 8E	10,5267	10,19
Clase 8EP	10,2956	9,97
Clase 8FH	10,4704 ³	10,16 ³
Clase 8G	10,3524 ¹	9,76 ¹
Clase 8GP	10,1203 ¹	9,55 ¹
Clase 9E	10,5416	10,20
Clase 9EP	10,3433	10,01
Clase 9FC	10,2956 ³	9,99 ³
Clase 9FH	10,4914 ³	10,18 ³
Clase 9G	10,3675 ¹	9,77 ¹
Clase 9GP	10,1049 ¹	9,53 ¹

¹La Clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

²La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.

³La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	31.612.717
Efectivo en el banco	2	1.520.564
Depósitos a plazo	2, 19	4.499.419
Suscripciones por cobrar		1.695
Interés por cobrar en swaps	2	1.986
Intereses y dividendos por cobrar, neto		377.767
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	90.685
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	103.882
Otros activos		472
Total de activos		38.209.187
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(383.077)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(4.411)
Otros pasivos		(2.709)
Total de pasivos		(390.197)
Total de patrimonio neto		37.818.990

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	10,000
Clase AEP	10,000
Clase AKH	100,000
Clase ANH	100,000
Clase IE	300,538
Clase IEP	10,000
Clase IGC	79.640,243
Clase IGH	10,000
Clase XE	4.709,223
Clase XGH	209.253,310
Clase ZE	44.064,200

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹
Clase AE [#]	100,3950
Clase AEP [#]	100,3950
Clase AKH [#]	100,4298 ¹
Clase ANH [#]	100,7301 ²
Clase IE [#]	100,4684
Clase IEP [#]	100,4690
Clase IGC [#]	100,6488 ³
Clase IGH [#]	100,6774 ³
Clase XE [#]	100,5537
Clase XGH [#]	100,7136 ³
Clase ZE [#]	100,4688

¹La clase está denominada en SEK. La divisa de base de la Cartera es EUR.²La clase está denominada en NOK. La divisa de base de la Cartera es EUR.³La clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 17 de julio de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		—
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	169.989
Ingresos por intereses en swaps		18.597
Total de ingresos		188.586
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(10.463)
Comisiones bancarias		(3.438)
Gastos por intereses en swaps		(6.222)
Otros gastos operativos	5	(5.751)
Total de gastos		(25.874)
Ingresos netos de inversiones		162.712
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(1.799)
(Pérdida) neta realizada en swaps		(123.984)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		196.012
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		6.575
Ganancia neta realizada		76.804
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(48.897)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		103.882
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		90.685
Cambio neto en ganancia no realizada		145.670
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		385.186
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		37.817.330
Reembolsos de acciones		(383.526)
Total de movimientos de capital		37.433.804
Patrimonio neto al final del periodo		37.818.990

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019
EUR	37.818.990

*Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	67.267.406
Efectivo en el banco	2	2.074.090
Por cobrar para la venta de inversiones		343.493
Suscripciones por cobrar		32.246
Intereses y dividendos por cobrar, neto		426.935
Otros activos		687
Total de activos		70.144.857
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.410.554)
Reembolsos pagaderos		(107)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(206.039)
(Pérdida) neta no realizada en futuros	2, 12	(22.191)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(18.870)
Otros pasivos		(5.588)
Total de pasivos		(1.663.349)
Total de patrimonio neto		68.481.508

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	573.722,550
Clase IEP	1.984.421,175
Clase IFH	327,000
Clase IKH	100,000
Clase LE	820.014,814
Clase NEP	30.259,524
Clase ZE	95.139,175
Clase ZEP	45.075,410
Clase ZFH	327,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase IE	10,6998	10,27	10,10
Clase IEP	10,3473	10,01	9,98
Clase IFH	10,4951 ¹	10,11 ¹	9,98 ¹
Clase IKH [#]	99,9099 ²	—	—
Clase LE	10,7233	10,30	10,11
Clase NEP	1.041,9269	1.007,53	—
Clase ZE	10,6809	10,26	10,09
Clase ZEP [#]	10,3050	—	—
Clase ZFH	10,4896 ¹	10,10 ¹	9,98 ¹

¹La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es EUR.²La clase está denominada en SEK. La divisa de base de la Cartera es EUR.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el período contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del período		29.456.674
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	370.735
Interés bancario	2	546
Total de ingresos		371.281
Gastos		
Comisión de gestión de activos	5	(91.997)
Comisiones bancarias		(2.134)
Gastos por intereses en futuros		(1.154)
Otros gastos operativos	5	(26.811)
Total de gastos		(122.096)
Ingresos netos de inversiones		249.185
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		319.758
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		8.191
(Pérdida) neta realizada en futuros		(273.252)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		644
Ganancia neta realizada		55.341
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.979.907
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(112.192)
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		8.250
Cambio neto en ganancia no realizada		1.875.965
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		2.180.491
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		46.289.899
Reembolsos de acciones		(9.073.396)
Dividendos	7	(372.160)
Total de movimientos de capital		36.844.343
Patrimonio neto al final del período		68.481.508

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
EUR	68.481.508	29.456.674	15.439.685

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	131.047.131
Efectivo en el banco	2	4.132.156
Por cobrar para la venta de inversiones		1.396.024
Suscripciones por cobrar		824.245
Interés por cobrar en swaps	2	421
Intereses y dividendos por cobrar, neto		1.253.768
Pago por adelantado abonado en transacciones swap	2	32.828
Ganancia neta no realizada en futuros	2, 12	145.889
Otros activos		5.741
Total de activos		138.838.203
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.663.822)
Reembolsos pagaderos		(947.820)
Interés pagadero en swaps	2	(35.558)
Pago por adelantado cobrado en transacciones swap	2	(17.350)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(212.731)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.887.046)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(88.149)
Otros pasivos		(24.131)
Total de pasivos		(5.876.607)
Total de patrimonio neto		132.961.596

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.850.894,288
Clase AEP	372.605,617
Clase AKH	100,000
Clase AUH	100,000
Clase DE	625.730,786
Clase DEP	520.767,369
Clase DUH	100,000
Clase IE	1.676.115,759
Clase W	1.580,192

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	29,4199	28,63	28,21
Clase AEP	15,1544	14,89	15,07
Clase AKH ²	99,9378 ¹	—	—
Clase AUH	10,8215 ²	10,38 ²	—
Clase DE	27,8028	27,13	26,88
Clase DEP	11,4645	11,30	11,50
Clase DUH	10,7420 ²	10,34 ²	—
Clase IE	29,4688	28,59	28,00
Clase W	62,3486	60,67	59,79

¹La clase está denominada en SEK. La divisa de base de la Cartera es EUR.²La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.³Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		97.043.105
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	1.714.925
Interés bancario	2	7.154
Ingresos por intereses en swaps		65.069
Ingresos por intereses en futuros		487
Total de ingresos		1.787.635
Gastos		
Comisión de gestión de activos	5	(475.525)
Comisiones bancarias		(14.399)
Gastos por intereses en swaps		(578.136)
Gastos por intereses en futuros		(11.589)
Otros gastos operativos	5	(125.174)
Total de gastos		(1.204.823)
Ingresos netos de inversiones		582.812
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.059.599
Ganancia neta realizada en swaps		201.188
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(179.957)
(Pérdida) neta realizada en futuros		(2.430.983)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		31.393
(Pérdida) neta realizada		(1.318.760)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		3.933.690
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(354.102)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(163.280)
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		463.191
Cambio neto en ganancia no realizada		3.879.499
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		3.143.551
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		45.623.846
Reembolsos de acciones		(12.743.234)
Dividendos	7	(105.672)
Total de movimientos de capital		32.779.940
Patrimonio neto al final del periodo		132.961.596

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
EUR	132.961.596	97.043.105	83.714.363

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	38.655.804
Efectivo en el banco	2	360.169
Depósitos a plazo	2, 19	805.418
Por cobrar para la venta de inversiones		506.594
Suscripciones por cobrar		27.953
Intereses y dividendos por cobrar, neto		417.146
Total de activos		40.773.084
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.099.644)
Reembolsos pagaderos		(47.156)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(469.526)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(35.642)
Otros pasivos		(8.579)
Total de pasivos		(1.660.547)
Total de patrimonio neto		39.112.537

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	391.659,836
Clase AEH	232.983,337
Clase AKH	100,000
Clase ANH	1.000,000
Clase ASH	2.972,051
Clase AU	39.552,941
Clase AUP	793.992,672
Clase DEC	49.761,783
Clase DEH	150.075,677
Clase DU	161.580,423
Clase IEH	428.316,115
Clase IU	100,000
Clase W	8.848,157
Clase WEH	7.260,489
Clase XUP	100,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEC	13,2869 ¹	13,23 ¹	13,85 ¹
Clase AEH	21,5247 ¹	20,89 ¹	20,74 ¹
Clase AKH ²	101,0884 ²	—	—
Clase ANH ³	10,1512 ³	—	—
Clase ASH	14,0137 ⁴	13,44 ⁴	13,08 ⁴
Clase AU	22,1720	21,18	20,42
Clase AUP	8,3212	8,16	8,29
Clase BU	—	—	9,85
Clase BUP	—	—	9,85
Clase DEC	9,6471 ¹	9,61 ¹	10,07 ¹
Clase DEH	16,5503 ¹	16,07 ¹	15,97 ¹
Clase DU	17,3039	16,54	15,96
Clase IEH	29,9693 ¹	28,96 ¹	28,54 ¹
Clase IU	11,1388	10,61	—
Clase W	30,1252	28,73	27,60
Clase WEH	20,9202 ¹	20,26 ¹	20,05 ¹
Clase XUP	11,4731	11,18	10,93

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁵Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		38.306.644
Ingreso		
Dividendos, neto	2	14.498
Interés sobre bonos, neto	2	1.030.544
Interés bancario	2	22.075
Total de ingresos		1.067.117
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(216.527)
Comisiones bancarias		(106)
Otros gastos operativos	5	(51.683)
Total de gastos		(268.316)
Ingresos netos de inversiones		798.801
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		549.596
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.115.808)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(4.503)
(Pérdida) neta realizada		(570.715)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		475.702
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(189.599)
Cambio neto en la ganancia no realizada		286.103
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		514.189
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.736.437
Reembolsos de acciones		(4.120.703)
Dividendos	7	(324.030)
Total de movimientos de capital		291.704
Patrimonio neto al final del periodo		39.112.537

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	39.112.537	38.306.644	43.736.834

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	53.173.602
Efectivo en el banco	2	629.496
Por cobrar para la venta de inversiones		770.704
Suscripciones por cobrar		25.115
Intereses y dividendos por cobrar, neto		622.011
Otros activos		76
Total de activos		55.221.004
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(411.199)
Reembolsos pagaderos		(85.228)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(43.301)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(60.853)
Otros pasivos		(13.562)
Total de pasivos		(614.143)
Total de patrimonio neto		54.606.861

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	99.830,952
Clase AEH	14.711,403
Clase AKH	100,000
Clase ANH	1.000,000
Clase ASH	14.773,834
Clase AU	65.945,657
Clase AUP	3.780.033,602
Clase DEH	23.407,204
Clase DU	17.405,334
Clase IEH	24.417,958
Clase IU	2.796,032
Clase SU	1.285,798
Clase SUP	61.705,825
Clase W	12.392,111
Clase XUP	100,000
Clase ZU	200,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEC	9,7792 ¹	9,97 ¹	10,87 ¹
Clase AEH	26,3600 ¹	26,10 ¹	26,85 ¹
Clase AKH ²	99,0669 ²	—	—
Clase ANH ³	9,9468 ³	—	—
Clase ASH	12,1736 ⁴	11,91 ⁴	12,01 ⁴
Clase AU	75,7676	73,87	73,66
Clase AUP	11,7056	11,75	12,41
Clase DEH	19,6240 ¹	19,44 ¹	20,03 ¹
Clase DU	53,9625	52,64	52,54
Clase IEH	28,4966 ¹	28,11 ¹	28,69 ¹
Clase IU ²	10,2884	—	—
Clase SU	30,4963	29,75	29,72
Clase SUP	11,2772	11,32	11,98
Clase W	62,7328	61,05	60,66
Clase XUP	10,9927	10,96	11,14
Clase ZU	11,9995	11,65	11,54

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.^{*}Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		57.760.204
Ingreso		
Dividendos, neto	2	17.161
Interés sobre bonos, neto	2	1.653.576
Interés bancario	2	24.745
Otros ingresos		1.072
Total de ingresos		1.696.554
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(384.276)
Comisiones bancarias		(642)
Otros gastos operativos	5	(85.667)
Comisiones varias	4	(4.256)
Total de gastos		(474.841)
Ingresos netos de inversiones		1.221.713
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(574.227)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		56.100
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		6.192
(Pérdida) neta realizada		(511.935)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		789.658
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(168.726)
Cambio neto en la ganancia no realizada		620.932
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		1.330.710
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.482.264
Reembolsos de acciones		(4.580.166)
Dividendos	7	(1.386.151)
Total de movimientos de capital		(4.484.053)
Patrimonio neto al final del periodo		54.606.861

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	54.606.861	57.760.204	81.487.718

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	119.904.727
Efectivo en el banco	2	12.082.439
Por cobrar para la venta de inversiones		1.980.069
Suscripciones por cobrar		74.770
Intereses y dividendos por cobrar, neto		1.640.458
Otros activos		10
Total de activos		135.682.473
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.080.735)
Reembolsos pagaderos		(68.651)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(721.854)
(Pérdida) neta no realizada en futuros	2, 12	(5.273)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(93.367)
Otros pasivos		(27.327)
Total de pasivos		(4.997.207)
Total de patrimonio neto		130.685.266

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	1.090.220,884
Clase AEH	230.577,725
Clase AKH	100,000
Clase ANH	1.000,000
Clase ASC	55.164,388
Clase ASH	86.163,964
Clase AU	1.649.044,484
Clase AUP	4.392.135,190
Clase DEH	266.061,138
Clase DU	160.575,666
Clase IEH	920.320,675
Clase XU	2.171.974,165
Clase XUP	627.011,100
Clase ZEH	1.010.590,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEC	5,6654 ¹	5,86 ¹	6,30 ¹
Clase AEH	15,0495 ¹	15,12 ¹	15,36 ¹
Clase AKH [#]	98,5114 ²	—	—
Clase ANH [#]	9,8908 ³	—	—
Clase ASC	7,5566 ⁴	7,72 ⁴	8,14 ⁴
Clase ASH	11,0383 ⁴	10,96 ⁴	10,91 ⁴
Clase AU	17,7981	17,60	17,34
Clase AUP	5,8649	5,97	6,23
Clase BU	—	—	9,93
Clase BUP	—	—	9,93
Clase DEH	11,7532 ¹	11,82 ¹	12,02 ¹
Clase DU	13,8841	13,75	13,56
Clase IEH	16,9947 ¹	17,01 ¹	17,15 ¹
Clase W	—	—	20,27
Clase XU	10,6553	10,46	—
Clase XUP	9,8877	10,00	—
Clase ZEH	10,9241 ¹	10,94 ¹	11,03 ¹

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el período contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		123.851.972
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	3.598.311
Interés bancario	2	78.205
Ingresos por intereses en futuros		518
Otros ingresos		1.702
Total de ingresos		3.678.736
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(637.505)
Comisiones bancarias		(262)
Otros gastos operativos	5	(173.751)
Total de gastos		(811.518)
Ingresos netos de inversiones		2.867.218
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(2.577.509)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.526.633)
Ganancia neta realizada en futuros		210.370
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(24.843)
(Pérdida) neta realizada		(3.918.615)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.010.376
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(459.160)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(38.804)
Cambio neto en la ganancia no realizada		512.412
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(538.985)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		46.932.810
Reembolsos de acciones		(38.394.761)
Dividendos	7	(1.165.770)
Total de movimientos de capital		7.372.279
Patrimonio neto al final del periodo		130.685.266

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	130.685.266	123.851.972	131.853.551

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	206.081.660
Efectivo en el banco	2	7.647.924
Por cobrar para la venta de inversiones		30.710
Suscripciones por cobrar		33.358
Intereses y dividendos por cobrar, neto		3.000.991
Total de activos		216.794.643
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.944.036)
Reembolsos pagaderos		(2.405.503)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.425.491)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(106.468)
Otros pasivos		(20.401)
Total de pasivos		(6.901.899)
Total de patrimonio neto		209.892.744

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	69.479,656
Clase AEH	25.362,136
Clase ASH	36.167,146
Clase AU	155.770,320
Clase AUP	323.445,799
Clase DEC	37.514,389
Clase DEH	34.287,344
Clase DU	59.806,779
Clase IEC	13.820,000
Clase IEH	4.309.703,772
Clase IU	4.640.444,919
Clase TEH	18.205,515
Clase XUP	100,000
Clase ZFH	100,000
Clase ZGH	100,000
Clase ZU	17.281,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEC	12,9169 ¹	12,86 ¹	13,34 ¹
Clase AEH	31,2238 ¹	30,28 ¹	29,77 ¹
Clase ASH	14,3525 ²	13,76 ²	13,25 ²
Clase AU	35,6492	34,04	32,47
Clase AUP	13,4686	13,20	13,28
Clase BU	—	—	9,72
Clase BUP	—	—	9,59
Clase DEC	9,7757 ¹	9,74 ¹	10,13 ¹
Clase DEH	22,5582 ¹	21,90 ¹	21,57 ¹
Clase DU	25,7134	24,57	23,49
Clase IEC	9,3199 ¹	9,24 ¹	9,49 ¹
Clase IEH	30,6060 ¹	29,55 ¹	28,78 ¹
Clase IU	10,9048	10,36	—
Clase TEH	10,9233 ¹	10,54 ¹	10,27 ¹
Clase XUP	10,9158	10,65	10,17
Clase ZFH	10,5297 ³	10,20 ³	—
Clase ZGH	11,4649 ⁴	11,02 ⁴	10,64 ⁴
Clase ZU	12,7840	12,17	11,53

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

*Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		218.412.478
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	6.184.397
Interés bancario	2	76.630
Ingresos por intereses en swaps		18.333
Total de ingresos		6.279.360
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(655.557)
Comisiones bancarias		(1.110)
Otros gastos operativos	5	(125.181)
Total de gastos		(781.848)
Ingresos netos de inversiones		5.497.512
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		31.720
Ganancia neta realizada en swaps		294.556
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(5.820.946)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		2.248
(Pérdida) neta realizada		(5.492.422)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		5.022.282
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(266.394)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(969.495)
Cambio neto en la ganancia no realizada		3.786.393
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		3.791.483
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		17.180.409
Reembolsos de acciones		(29.321.218)
Dividendos	7	(170.408)
Total de movimientos de capital		(12.311.217)
Patrimonio neto al final del periodo		209.892.744

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	209.892.744	218.412.478	296.403.063

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	41.345.166
Efectivo en el banco	2	218.877
Depósitos a plazo	2, 19	1.301.142
Por cobrar para la venta de inversiones		200.018
Suscripciones por cobrar		87.385
Intereses y dividendos por cobrar, neto		521.382
Total de activos		43.673.970
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(697.805)
Reembolsos pagaderos		(122.529)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(3.310)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(4.579)
Otros pasivos		(5.975)
Total de pasivos		(834.198)
Total de patrimonio neto		42.839.772

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	36.155,522
Clase AKH	100,000
Clase AS	101.469,352
Clase ASC	21.081,685
Clase ASH	132.655,199
Clase AU	92.517,439
Clase AUP	6.057,443
Clase AVC	100,000
Clase AVH	100,000
Clase DEH	16.271,944
Clase IEH	250,000
Clase IGH	200,000
Clase ISH	250,000
Clase IU	250,000
Clase XU	3.114.861,022
Clase ZU	250,000
Clase ZUP	100,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	11,7129 ¹	11,22 ¹	11,09 ¹
Clase AKH [#]	100,4316 ²	—	—
Clase AS	11,4428 ³	10,57 ³	9,81 ³
Clase ASC	11,0751 ³	10,70 ³	10,78 ³
Clase ASH	12,6225 ³	11,96 ³	11,58 ³
Clase AU	12,8255	12,10	11,60
Clase AUP	11,4901	11,06	10,96
Clase AVC	10,6766 ⁴	10,34 ⁴	10,31 ⁴
Clase AVH	11,2527 ⁴	10,69 ⁴	10,31 ⁴
Clase DEH	11,4496 ¹	10,98 ¹	10,87 ¹
Clase IEH	12,0793 ¹	11,53 ¹	11,31 ¹
Clase IGH	12,6653 ⁵	12,02 ⁵	11,65 ⁵
Clase ISH	13,0723 ³	12,34 ³	11,85 ³
Clase IU	13,2627	12,46	11,87
Clase XU	12,4181	11,63	11,00
Clase ZU	13,2940	12,50	11,91
Clase ZUP	10,9402	10,50	—

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en AUD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁵La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		38.976.738
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	969.783
Interés bancario	2	22.125
Total de ingresos		991.908
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(110.543)
Comisiones bancarias		(105)
Gastos por intereses en swaps		(19.459)
Otros gastos operativos	5	(44.711)
Comisiones varias	4	(22.448)
Total de gastos		(197.266)
Ingresos netos de inversiones		794.642
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.084.414
(Pérdida) neta realizada en swaps		(215.222)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(242.290)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(44.255)
Ganancia neta realizada		582.647
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		953.441
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		196.459
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		8.369
Cambio neto en ganancia no realizada		1.158.269
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		2.535.558
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		37.788.394
Reembolsos de acciones		(36.457.919)
Dividendos	7	(2.999)
Total de movimientos de capital		1.327.476
Patrimonio neto al final del periodo		42.839.772

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	42.839.772	38.976.738	48.999.177

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	21.622.557
Efectivo en el banco	2	449.474
Depósitos a plazo	2, 19	2.595.422
Suscripciones por cobrar		35.719
Reembolsos de comisiones de gestión de activos por cobrar		6.067
Intereses y dividendos por cobrar, neto		13.465
Total de activos		24.722.704
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(247.554)
Reembolsos pagaderos		(5)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(160.023)
(Pérdida) neta no realizada en futuros	2, 12	(5.247)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(11.554)
Otros pasivos		(4.169)
Total de pasivos		(428.552)
Total de patrimonio neto		24.294.152

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	51.672,971
Clase AEP	48.322,200
Clase DE	50.297,244
Clase IE	110.875,982
Clase IEP	48.322,200
Clase LE	1.891.659,886
Clase LEP	48.322,200
Clase ZE	48.322,200
Clase ZEP	48.322,200

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [*]	31 de marzo de 2019
Clase AE	10,2473	10,03
Clase AEP	10,1911	9,99
Clase DE	10,1375	9,96
Clase IE	10,3507	10,10
Clase IEP	10,2934	10,05
Clase LE	10,3740	10,11
Clase LEP	10,3157	10,07
Clase ZE	10,3211	10,08
Clase ZEP	10,2648	10,03

^{*}Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		22.759.479
Ingreso		
Dividendos, neto	2	12.481
Interés sobre bonos, neto	2	16.785
Interés bancario	2	184
Ingresos por intereses en futuros		177
Reembolsos de comisiones de gestión de activos	2	10.783
Otros ingresos		1.404
Total de ingresos		41.814
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(69.120)
Comisiones bancarias		(8.332)
Gastos por intereses en futuros		(569)
Otros gastos operativos	5	(25.052)
Total de gastos		(103.073)
(Pérdida) neta de inversiones		(61.259)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(21.464)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		194.021
(Pérdida) neta realizada en futuros		(10.059)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(26.698)
Ganancia neta realizada		135.800
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		643.508
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(110.408)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(21.147)
Cambio neto en la ganancia no realizada		511.953
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		586.494
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.182.794
Reembolsos de acciones		(232.199)
Dividendos	7	(2.416)
Total de movimientos de capital		948.179
Patrimonio neto al final del periodo		24.294.152

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
EUR	24.294.152	22.759.479

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	47.767.385
Efectivo en el banco	2	3.938.060
Depósitos a plazo	2, 19	4.717.895
Por cobrar para la venta de inversiones		102.626
Suscripciones por cobrar		39.913
Reembolsos de comisiones de gestión de activos por cobrar		7.862
Interés por cobrar en swaps	2	5.613
Intereses y dividendos por cobrar, neto		52.741
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	476.249
Ganancia neta no realizada en futuros	2, 12	276.652
Otros activos		11.029
Total de activos		57.396.025
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(75)
Pagadero por inversiones adquiridas		(145.975)
Reembolsos pagaderos		(225.602)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(375.678)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(62.997)
Otros pasivos		(14.004)
Total de pasivos		(824.331)
Total de patrimonio neto		56.571.694

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	147.134,384
Clase AEH	404.166,732
Clase AKH	100,000
Clase AU	421.210,527
Clase AUP	496.194,214
Clase DEH	118.539,064
Clase DU	237.707,246
Clase IEH	100,000
Clase IGH	12.209,135
Clase IU	358.658,010
Clase W	26.123,425

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEC	12,823 ¹	12,83 ¹	13,64 ¹
Clase AEH	25,673 ¹	25,52 ¹	26,78 ¹
Clase AKH ²	100,097 ³	—	—
Clase AU	37,5453	36,74	37,42
Clase AUP	14,4604	14,24	14,70
Clase BU	—	—	10,06
Clase DEH	18,7168 ¹	18,66 ¹	19,72 ¹
Clase DU	24,8486	24,40	25,01
Clase IEH ²	9,9642 ¹	—	—
Clase IGH	25,7456 ³	25,36 ³	26,15 ³
Clase IU	27,5485	26,86	27,17
Clase W	61,9187	60,62	61,81

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		59.178.404
Ingreso		
Dividendos, neto	2	152.612
Interés sobre bonos, neto	2	189.524
Interés bancario	2	110.714
Ingresos por intereses en swaps		91.041
Ingresos por intereses en futuros		12.931
Reembolsos de comisiones de gestión de activos	2	12.946
Otros ingresos		15.848
Total de ingresos		585.616
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(399.282)
Comisiones bancarias		(4.121)
Gastos por intereses en swaps		(8.614)
Gastos por intereses en futuros		(1.646)
Otros gastos operativos	5	(84.171)
Total de gastos		(497.834)
Ingresos netos de inversiones		87.782
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		418.722
(Pérdida) neta realizada en swaps		(222.590)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(473.032)
(Pérdida) neta realizada en futuros		(978.573)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(66.267)
(Pérdida) neta realizada en reembolso de impuestos		(61)
(Pérdida) neta realizada		(1.321.801)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.269.030
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		181.610
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(143.324)
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		414.617
Cambio neto en ganancia no realizada		1.721.933
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		487.914
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		4.381.090
Reembolsos de acciones		(7.412.270)
Dividendos	7	(63.444)
Total de movimientos de capital		(3.094.624)
Patrimonio neto al final del periodo		56.571.694

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	56.571.694	59.178.404	70.260.271

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	257.460.292
Efectivo en el banco	2	8.219.591
Por cobrar para la venta de inversiones		4.558.149
Suscripciones por cobrar		592.210
Reembolsos de comisiones de gestión de activos por cobrar	2	56.166
Intereses y dividendos por cobrar, neto		1.833.412
Otros activos		22.918
Total de activos		272.742.738
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(435.614)
Opciones vendidas al valor de mercado	2, 12	(205.188)
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.737.993)
Reembolsos pagaderos		(411.999)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.963.946)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(334.299)
Otros pasivos		(66.447)
Total de pasivos		(8.155.486)
Total de patrimonio neto		264.587.252

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	93.219,102
Clase AEC	9.902.685,611
Clase AEH	1.654.455,707
Clase AEP	1.844.353,436
Clase AS	100,000
Clase ASC	11.579,834
Clase ASH	2.331,359
Clase ASP	5.285,702
Clase AU	885.638,110
Clase AUM	100,000
Clase AUP	1.060.606,973
Clase DEC	6.106.242,131
Clase DEH	649.080,494
Clase DEP	606.325,771
Clase DU	640.155,398
Clase DUP	2.236.500,001
Clase ZE	148.272,430
Clase ZEC	100,000
Clase ZEH	15.181,566
Clase ZFH	100,000
Clase ZU	118.062,457
Clase ZUP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		281.201.768
Ingreso		
Dividendos, neto	2	2.882.700
Interés sobre bonos, neto	2	2.516.196
Interés bancario	2	37.049
Ingresos por intereses en futuros		74.362
Reembolsos de comisiones de gestión de activos	2	113.772
Otros ingresos		40
Total de ingresos		5.624.119
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.123.301)
Comisiones bancarias		(64.780)
Gastos por intereses en futuros		(6.068)
Otros gastos operativos	5	(420.010)
Total de gastos		(2.614.159)
Ingresos netos de inversiones		3.009.960
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		607.326
(Pérdida) neta realizada en opciones		(3.183.113)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.717.956)
(Pérdida) neta realizada en futuros		(36)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(49.202)
(Pérdida) neta realizada en reembolso de impuestos		(839)
(Pérdida) neta realizada		(5.343.820)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(63.477)
Cambio en la ganancia neta no realizada sobre opciones		92.959
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(811.455)
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(781.973)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones Valor Liquidativo Total		(3.115.833)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		34.954.940
Reembolsos de acciones		(42.708.034)
Dividendos	7	(5.745.589)
Total de movimientos de capital		(13.498.683)
Patrimonio neto al final del periodo		264.587.252

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	264.587.252	281.201.768	298.226.164

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	11,0244 ¹	10,48 ¹	9,50 ¹
Clase AEC	8,2890 ¹	8,48 ¹	9,22 ¹
Clase AEH	16,9536 ¹	16,86 ¹	17,26 ¹
Clase AEP	9,8996 ¹	9,68 ¹	9,32 ¹
Clase AS	10,4903 ²	10,08 ²	—
Clase ASC	9,5169 ²	9,62 ²	—
Clase ASH	10,2376 ²	10,07 ²	—
Clase ASP	9,6222 ²	9,49 ²	—
Clase AU	18,7221	18,33	18,20
Clase AUM [#]	10,0376	—	—
Clase AUP	9,4857	9,55	10,07
Clase DEC	7,9825 ¹	8,19 ¹	8,98 ¹
Clase DEH	9,8363 ¹	9,82 ¹	10,13 ¹
Clase DEP	9,4540 ¹	9,28 ¹	9,00 ¹
Clase DU	11,7243	11,52	11,53
Clase DUP	8,7677	8,86	9,42
Clase ZE	11,1664 ¹	10,58 ¹	9,54 ¹
Clase ZEC	9,0806 ¹	9,26 ¹	—
Clase ZEH	10,1259 ¹	10,05 ¹	10,23 ¹
Clase ZFH	10,0529 ³	9,99 ³	—
Clase ZU	10,8336	10,58	10,45
Clase ZUP	9,4551	9,50	—

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

²La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

³La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	822.714.242
Efectivo en el banco	2	21.991.605
Por cobrar para la venta de inversiones		11.040.076
Suscripciones por cobrar		9.048.704
Intereses y dividendos por cobrar, neto		481.257
Otros activos		21.496
Total de activos		865.297.380
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.195.027)
Reembolsos pagaderos		(23.432.103)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(663.705)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(763.265)
Impuesto sobre la ganancia de capital no realizado sobre la inversión		(1.401.035)
Otros pasivos		(196.039)
Total de pasivos		(28.651.174)
Total de patrimonio neto		836.646.206

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	751.836,086
Clase AEP	184.686,588
Clase AU	4.938.255,473
Clase AUP	5.133,658
Clase DEH	149.314,136
Clase DU	445.100,245
Clase IE	4.277.859,034
Clase IEH	78.229,267
Clase IU	7.781.417,322
Clase IUP	100,000
Clase W	18.014,468
Clase XU	3.667.407,433
Clase ZE	706.643,416
Clase ZEP	2.001.127,446
Clase ZG	635.684,042
Clase ZU	8.694.557,796

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	42,053 ¹	39,72 ¹	37,45 ¹
Clase AEP	14,854 ¹	13,51 ¹	11,37 ¹
Clase AU	68,821 ¹	64,03	58,62
Clase AUP	11,1324	10,43	—
Clase BU	—	—	10,36
Clase DEH	30,7011 ¹	29,11 ¹	27,65 ¹
Clase DU	36,1780	33,79	31,16
Clase IE	13,9025 ¹	12,50 ¹	10,36 ¹
Clase IEH	11,1787 ¹	10,51 ¹	—
Clase IU	13,8764	12,86	11,67
Clase IUP	11,2494	10,49	—
Clase W	105,0529	97,72	89,41
Clase XU	15,9278	14,70	13,23
Clase ZE	15,6999 ¹	14,13 ¹	11,72 ¹
Clase ZEP	15,1030 ¹	13,68 ¹	11,49 ¹
Clase ZG	16,2240 ²	14,22 ²	12,00 ²
Clase ZU	16,8312	15,60	14,18

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La Clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.³Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		640.308.193
Ingreso		
Dividendos, neto	2	4.501.103
Interés bancario	2	161.981
Total de ingresos		4.663.084
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.103.978)
Comisiones bancarias		(654)
Otros gastos operativos	5	(1.099.396)
Total de gastos		(5.204.028)
(Pérdida) neta de inversiones		(540.944)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		31.950.018
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.388.264)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(952.477)
(Pérdida) neta realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(4.946)
Ganancia neta realizada		29.604.331
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		24.698.195
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(359.656)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(784.293)
Cambio neto en la ganancia no realizada		23.554.246
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		52.617.633
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		649.926.164
Reembolsos de acciones		(505.968.207)
Dividendos	7	(237.577)
Total de movimientos de capital		143.720.380
Patrimonio neto al final del periodo		836.646.206

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	836.646.206	640.308.193	449.478.043

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	93.918.751
Efectivo en el banco	2	1.220.609
Por cobrar para la venta de inversiones		221.017
Suscripciones por cobrar		2.318
Intereses y dividendos por cobrar, neto		137.086
Otros activos		1.038
Total de activos		95.500.819
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(8.572)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(18.146)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(77.057)
Impuesto sobre la ganancia de capital no realizado sobre la inversión		(100.831)
Otros pasivos		(13.761)
Total de pasivos		(218.367)
Total de patrimonio neto		95.282.452

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	2.822,346
Clase AU	9.589,330
Clase DEH	44.339,524
Clase DU	71.318,908
Clase IEH	659,367
Clase IU	4.676.205,000
Clase ZU	200,000
Clase 1E	3.245.875,172
Clase 1U	4.829.204,018
Clase 2E	2.030.150,894
Clase 2U	100,000
Clase 8E	1.156.290,447
Clase 8U	1.689.556,789

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	28,3878 ¹	28,73 ¹	33,07 ¹
Clase AU	44,5671	44,39	49,41
Clase DEH	20,4599 ¹	20,77 ¹	24,09 ¹
Clase DU	31,5375	31,53	35,36
Clase IEH	16,8750 ¹	17,00 ¹	19,41 ¹
Clase IU [#]	10,4806	—	—
Clase ZU	10,0502	9,97	11,02
Clase 1E	1,3201 ¹	1,28 ¹	—
Clase 1U	1,4390	1,43	—
Clase 2E	11,9492 ¹	11,51 ¹	—
Clase 2U	11,4874	11,40	—
Clase 8E	1,4301 ¹	1,38 ¹	—
Clase 8U	1,5592	1,55	—

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		47.448.924
Ingreso		
Dividendos, neto	2	669.070
Interés bancario	2	16.101
Total de ingresos		685.171
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(382.509)
Comisiones bancarias		(2.763)
Otros gastos operativos	5	(59.582)
Total de gastos		(444.854)
Ingresos netos de inversiones		240.317
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		298.046
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(43.660)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(29.214)
(Pérdida) neta realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(387)
Ganancia neta realizada		224.785
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.146.683)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(6.898)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(73.528)
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(2.227.109)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones Valor Liquidativo Total		(1.762.007)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		52.612.564
Reembolsos de acciones		(3.017.029)
Total de movimientos de capital		49.595.535
Patrimonio neto al final del periodo		95.282.452

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	95.282.452	47.448.924	4.616.973

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	572.209.487
Efectivo en el banco	2	267.294
Por cobrar para la venta de inversiones		2.943.791
Suscripciones por cobrar		156.997
Intereses y dividendos por cobrar, neto		1.134.758
Otros activos		2
Total de activos		576.712.329
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(7.248.896)
Reembolsos pagaderos		(2.076.652)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(61.154)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(469.150)
Otros pasivos		(68.832)
Total de pasivos		(9.924.684)
Total de patrimonio neto		566.787.645

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	100,000
Clase AUP	100,000
Clase DEC	100,000
Clase DUP	100,000
Clase IU	100,000
Clase TE	100,000
Clase ZU	100,000
Clase 1E	2.609.888,741
Clase 1EP	1.866.482,823
Clase 1SC	649.685,886
Clase 1SH	140.482,465
Clase 1ST	323.473,107
Clase 1U	889.902,658
Clase 1UP	705.304,205
Clase 1VT	10.329,191
Clase 2E	1.420.944,570
Clase 2EP	21.233.852,945
Clase 2U	100,000
Clase 2UP	5.279.389,571
Clase 3E	294.798,654
Clase 3EP	13.143.812,374
Clase 3U	38.500,926
Clase 3UP	35.975,730
Clase 8E	146.340,590
Clase 8EP	165,977
Clase 8U	13.158,578
Clase 8UP	71.308,213
Clase 9E	100,000
Clase 9EP	100,000
Clase 9U	100,000
Clase 9UP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		896.154.687
Ingreso		
Dividendos, neto	2	12.720.748
Interés bancario	2	89.199
Total de ingresos		12.809.947
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.572.714)
Comisiones bancarias		(6.402)
Otros gastos operativos	5	(439.753)
Total de gastos		(4.018.869)
Ingresos netos de inversiones		8.791.078
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		32.387.374
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(191.593)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(181.497)
Ganancia neta realizada		32.014.284
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(18.069.354)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(62.527)
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(18.131.881)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		22.673.481
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		90.505.698
Reembolsos de acciones		(430.164.144)
Dividendos	7	(12.382.077)
Total de movimientos de capital		(352.040.523)
Patrimonio neto al final del periodo		566.787.645

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
USD	566.787.645	896.154.687

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019
Clase AEC	9,9429 ¹	10,11 ¹
Clase AUP	10,2622	10,27
Clase DEC	9,9041 ¹	10,09 ¹
Clase DUP	10,2050	10,24
Clase IU	10,7278	10,45
Clase TE	11,2727 ¹	10,66 ¹
Clase ZU	10,7243	10,45
Clase 1E	11,2089 ¹	10,64 ¹
Clase 1EP	10,8233 ¹	10,51 ¹
Clase 1SC	10,1907 ²	10,25 ²
Clase 1SH	10,5675 ²	10,38 ²
Clase 1ST	10,1940 ²	10,25 ²
Clase 1U	10,6660	10,43
Clase 1UP	10,2853	10,29
Clase 1VT	10,1621 ³	10,24 ³
Clase 2E	11,4806 ¹	10,86 ¹
Clase 2EP	10,8868 ¹	10,54 ¹
Clase 2U	10,7232	10,45
Clase 2UP	10,3617	10,33
Clase 3E	11,2878 ¹	10,67 ¹
Clase 3EP	10,9003 ¹	10,54 ¹
Clase 3U	10,7411	10,46
Clase 3UP	10,3761	10,34
Clase 8E	11,2641 ¹	10,66 ¹
Clase 8EP	10,8529 ¹	10,51 ¹
Clase 8U	10,7215	10,45
Clase 8UP	10,3432	10,32
Clase 9E	11,3025 ¹	10,68 ¹
Clase 9EP	10,8931 ¹	10,52 ¹
Clase 9U	10,7551	10,46
Clase 9UP	10,3593	10,31

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

²La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

³La clase está denominada en AUD. La divisa base de la Cartera es el USD.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Global Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	465.257.954
Efectivo en el banco	2	830.524
Por cobrar para la venta de inversiones		665.485
Suscripciones por cobrar		231.988
Intereses y dividendos por cobrar, neto		259.284
Otros activos		25.951
Total de activos		467.271.186
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.588.509)
Reembolsos pagaderos		(40.339)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(518.850)
Impuesto sobre la ganancia de capital no realizado sobre la inversión		(240.551)
Otros pasivos		(71.970)
Total de pasivos		(3.460.219)
Total de patrimonio neto		463.810.967

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	293.808,669
Clase ZU	100,000
Clase 1E	40.997.987,675
Clase 1U	65.089.188,836
Clase 2E	100,000
Clase 2U	306.806,333
Clase 3U	9.963.406,563
Clase 8E	121.976,592
Clase 8U	18.847.504,867
Clase 9U	73.667,379

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019
Clase IU	11,3223	10,66
Clase ZU	11,3168	10,66
Clase 1E	2,9065 ¹	2,67 ¹
Clase 1U	3,1683	2,99
Clase 2E	11,8332 ¹	10,82 ¹
Clase 2U	11,3169	10,66
Clase 3U	3,3159	3,12
Clase 8E	4,2079 ¹	3,85 ¹
Clase 8U	4,5867	4,32
Clase 9U	11,3319	10,66

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		441.869.956
Ingreso		
Dividendos, neto	2	2.753.276
Interés bancario	2	69.094
Total de ingresos		2.822.370
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.078.071)
Comisiones bancarias		(368)
Otros gastos operativos	5	(374.375)
Total de gastos		(3.452.814)
(Pérdida) neta de inversiones		(630.444)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		12.317.438
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(7.229)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		12.170
(Pérdida) neta realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(1.076)
Ganancia neta realizada		12.321.303
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		14.829.867
Cambio en la (pérdida) neta no realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(240.551)
Cambio neto en ganancia no realizada		14.589.316
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		26.280.175
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		193.091.145
Reembolsos de acciones		(197.430.309)
Total de movimientos de capital		(4.339.164)
Patrimonio neto al final del periodo		463.810.967

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
USD	463.810.967	441.869.956

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	383.259.858
Efectivo en el banco	2	3.996.127
Suscripciones por cobrar		8.407.440
Intereses y dividendos por cobrar, neto		134.400
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	2.462
Otros activos		30.172
Total de activos		395.830.459
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(10.879.387)
Reembolsos pagaderos		(82.173)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(292.185)
Otros pasivos		(77.429)
Total de pasivos		(11.331.174)
Total de patrimonio neto		384.499.285

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	3.353.891,465
Clase AEP	1.094.115,061
Clase AUP	100,000
Clase DE	482.159,004
Clase IE	2.224.821,365
Clase NE	2.124.611,000
Clase XE	1.486.147,433
Clase XG	100,000
Clase XGH	100,000
Clase ZE	813.728,998
Clase ZFH	100,000
Clase ZG	30.078,367
Clase ZGH	12.465,876
Clase ZU	9.529.771,575

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	33,0552	29,93	26,62
Clase AEP	11,1091	10,06	—
Clase AGH	—	—	26,84 ¹
Clase AUP	10,2823 ²	9,59 ²	—
Clase DE	25,3967	23,05	20,61
Clase IE	47,2701	42,61	37,58
Clase IGH	—	—	36,65 ¹
Clase NE [#]	10,3368	—	—
Clase XE	11,8092	10,60	—
Clase XG	11,8942 ¹	10,41 ¹	—
Clase XGH	16,0343 ¹	14,34 ¹	12,44 ¹
Clase ZE	11,6567	10,51	—
Clase ZFH	11,5630 ³	10,45 ³	—
Clase ZG	11,7524 ¹	10,32 ¹	—
Clase ZGH	33,9390 ¹	30,48 ¹	26,67 ¹
Clase ZU	10,7750 ²	10,01 ²	—

¹La Clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.²La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.³La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es el EUR.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el período contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del período		196.527.339
Ingreso		
Dividendos, neto	2	1.695.719
Interés bancario	2	52.078
Total de ingresos		1.747.797
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.445.311)
Comisiones bancarias		(4.714)
Otros gastos operativos	5	(354.029)
Total de gastos		(1.804.054)
(Pérdida) neta de inversiones		(56.257)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		11.251.142
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		11.121
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(142.718)
Ganancia neta realizada		11.119.545
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		13.713.009
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		4.764
Cambio neto en ganancia no realizada		13.717.773
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		24.781.061
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		265.053.404
Reembolsos de acciones		(101.862.519)
Total de movimientos de capital		163.190.885
Patrimonio neto al final del período		384.499.285

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
EUR	384.499.285	196.527.339	29.122.424

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	938.350.214
Efectivo en el banco	2	3.944.428
Por cobrar para la venta de inversiones		2.359.078
Suscripciones por cobrar		538.167
Intereses y dividendos por cobrar, neto		583.323
Otros activos		592
Total de activos		945.775.802
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.591.239)
Reembolsos pagaderos		(540.270)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.685.900)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(814.780)
Otros pasivos		(132.750)
Total de pasivos		(4.764.939)
Total de patrimonio neto		941.010.863

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	1.006.374,302
Clase AU	375.263,144
Clase DEH	73.804,221
Clase DU	693.000,336
Clase IEH	482.431,236
Clase IU	6.234.323,093
Clase W	2.042,035
Clase ZE	34.695,509
Clase ZEH	1.330.035,499
Clase ZU	100,000
Clase 1E	4.005.205,944
Clase 1EH	623.480,254
Clase 1EP	367.852,844
Clase 1U	14.703.116,059
Clase 2E	1.014.219,352
Clase 2U	11.302.361,297
Clase 3EH	10.625,846
Clase 3U	607.294,559
Clase 8E	1.645.931,955
Clase 8U	5.255.284,955
Clase 9EH	100.100,000
Clase 9U	4.305.184,452

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		907.780.896
Ingreso		
Dividendos, neto	2	5.221.873
Interés bancario	2	41.814
Total de ingresos		5.263.687
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.968.341)
Comisiones bancarias		(370)
Otros gastos operativos	5	(803.092)
Total de gastos		(5.771.803)
(Pérdida) neta de inversiones		(508.116)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		13.571.894
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(3.944.396)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		41.189
Ganancia neta realizada		9.668.687
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		44.426.608
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(750.104)
Cambio neto en la ganancia no realizada		43.676.504
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		52.837.075
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		78.954.116
Reembolsos de acciones		(98.561.224)
Total de movimientos de capital		(19.607.108)
Patrimonio neto al final del periodo		941.010.863

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	941.010.863	907.780.896	229.967.862

Threadneedle (Lux) - American

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	45,5493 ¹	43,59 ¹	42,33 ¹
Clase AU	76,5685	72,16	68,00
Clase BU	—	—	10,11
Clase DEH	33,8877 ¹	32,49 ¹	31,68 ¹
Clase DU	29,9407	28,27	26,73
Clase IEH	48,4602 ¹	46,17 ¹	44,45 ¹
Clase IU	51,5460	48,36	45,17
Clase W	101,4178	95,43	89,67
Clase ZE	11,4868 ¹	10,47 ¹	—
Clase ZEH	10,3260 ¹	9,84 ¹	—
Clase ZU	10,8238	10,16	—
Clase 1E	11,1830 ¹	10,23 ¹	—
Clase 1EH	10,2075 ¹	9,76 ¹	—
Clase 1EP	11,1097 ¹	10,16 ¹	—
Clase 1U	10,5292	9,92	—
Clase 2E	11,2519 ¹	10,26 ¹	—
Clase 2U	10,5924	9,95	—
Clase 3EH	10,2825 ¹	9,80 ¹	—
Clase 3U	10,6107	9,95	—
Clase 8E	11,2464 ¹	10,25 ¹	—
Clase 8U	10,5852	9,94	—
Clase 9EH	10,2847 ¹	9,80 ¹	—
Clase 9U	10,6103	9,95	—

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - American Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	339.478.629
Efectivo en el banco	2	11.358.248
Depósitos a plazo	2, 19	8.659.198
Suscripciones por cobrar		112.766
Intereses y dividendos por cobrar, neto		94.929
Total de activos		359.703.770
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(721.632)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(141.603)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(408.170)
Otros pasivos		(51.070)
Total de pasivos		(1.322.475)
Total de patrimonio neto		358.381.295

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AD	1.000,000
Clase AEH	32.785,658
Clase AN	1.000,000
Clase AU	231.739,298
Clase DEH	16.657,908
Clase DU	169.477,537
Clase ID	1.000,000
Clase IE	100,000
Clase IEH	163.700,081
Clase IN	1.000,000
Clase W	12.516,266
Clase ZEH	100,000
Clase ZU	32.640,000
Clase 1E	16.068.963,231
Clase 1EH	255.452,534
Clase 1EP	576.583,035
Clase 1U	46.013.460,475
Clase 2EH	100,000
Clase 2U	100,000
Clase 3E	8.849.842,829
Clase 3U	4.539.545,435
Clase 8EH	216.213,855
Clase 8U	3.650.723,618
Clase 9E	100,000
Clase 9U	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		363.379.073
Ingreso		
Dividendos, neto	2	1.150.370
Interés bancario	2	284.036
Total de ingresos		1.434.406
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(2.548.238)
Comisiones bancarias		(62)
Otros gastos operativos	5	(299.177)
Total de gastos		(2.847.477)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.413.071)
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(9.727)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(291.880)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		21.632
(Pérdida) neta realizada		(279.975)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		14.843.077
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(81.967)
Cambio neto en la ganancia no realizada		14.761.110
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		13.068.064
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		48.896.050
Reembolsos de acciones		(66.961.892)
Total de movimientos de capital		(18.065.842)
Patrimonio neto al final del periodo		358.381.295

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	358.381.295	363.379.073	9.353.783

Threadneedle (Lux) - American Select

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AD ¹	10,538 ¹	—	—
Clase AEH	28,703 ²	28,15 ²	27,28 ²
Clase AN ¹	10,801 ³	—	—
Clase AU	25,549 ¹	24,67	23,20
Clase DEH	19,857 ²	19,54 ²	19,09 ²
Clase DU	22,781 ¹	22,08	20,92
Clase ID ¹	10,559 ¹	—	—
Clase IE ¹	10,569 ²	—	—
Clase IEH	30,103 ²	29,40 ²	28,27 ²
Clase IN ¹	10,820 ³	—	—
Clase W	27,000 ⁸	26,07	24,50
Clase ZEH	10,159 ¹²	9,92 ²	—
Clase ZU	10,639 ²	10,24	—
Clase 1E	4,015 ⁸²	3,76 ²	—
Clase 1EH	3,036 ⁸²	2,98 ²	—
Clase 1EP	3,993 ³²	3,74 ²	—
Clase 1U	4,377 ⁹	4,23	—
Clase 2EH	10,487 ³²	10,24 ²	—
Clase 2U	10,785 ⁶	10,38	—
Clase 3E	3,230 ⁴²	3,01 ²	—
Clase 3U	3,521 ⁷	3,38	—
Clase 8EH	2,638 ⁷²	2,58 ²	—
Clase 8U	4,990 ⁰	4,80	—
Clase 9E	11,261 ⁶²	10,51 ²	—
Clase 9U	10,813 ⁰	10,39	—

¹La clase está denominada en DKK. La divisa base de la Cartera es el USD.

²La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

³La clase está denominada en NOK. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁴Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	229.062.047
Efectivo en el banco	2	2.376.278
Por cobrar para la venta de inversiones		1.862.722
Suscripciones por cobrar		121.352
Intereses y dividendos por cobrar, neto		264.424
Otros activos		15
Total de activos		233.686.838
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.889.571)
Reembolsos pagaderos		(653.026)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(838)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(228.464)
Otros pasivos		(29.522)
Total de pasivos		(5.801.421)
Total de patrimonio neto		227.885.417

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	100,000
Clase AU	100,000
Clase DEH	100,000
Clase DU	100,000
Clase IE	100,000
Clase IU	100,000
Clase ZU	100,000
Clase 1E	84.487,929
Clase 1EP	934.889,176
Clase 1U	10.016.194,933
Clase 2U	2.142.934,358
Clase 3EH	3.961,863
Clase 3U	1.994.582,596
Clase 8U	1.952.367,344
Clase 9EH	100,000
Clase 9U	3.569.216,396

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019
Clase AEH	10,5576 ¹	10,53 ¹
Clase AU	10,8846	10,69
Clase DEH	10,5089 ¹	10,51 ¹
Clase DU	10,8317	10,66
Clase IE ¹	10,4605 ¹	—
Clase IU	10,9705	10,72
Clase ZU	10,9636	10,72
Clase 1E	11,4699 ¹	10,92 ¹
Clase 1EP	11,3847 ¹	10,84 ¹
Clase 1U	10,9003	10,69
Clase 2U	10,9633	10,72
Clase 3EH	10,6455 ¹	10,57 ¹
Clase 3U	10,9751	10,73
Clase 8U	10,9643	10,72
Clase 9EH	10,6642 ¹	10,58 ¹
Clase 9U	10,9827	10,73

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.¹Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		256.158.593
Ingreso		
Dividendos, neto	2	1.085.401
Interés bancario	2	15.679
Total de ingresos		1.101.080
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.480.581)
Comisiones bancarias		(93)
Otros gastos operativos	5	(195.572)
Total de gastos		(1.676.246)
(Pérdida) neta de inversiones		(575.166)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		22.271.744
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.301)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		956
Ganancia neta realizada		22.270.399
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(15.760.933)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(195)
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(15.761.128)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		5.934.105
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		24.412.131
Reembolsos de acciones		(58.619.412)
Total de movimientos de capital		(34.207.281)
Patrimonio neto al final del periodo		227.885.417

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
USD	227.885.417	256.158.593

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	151.015.729
Efectivo en el banco	2	1.991.809
Por cobrar para la venta de inversiones		379.228
Intereses y dividendos por cobrar, neto		448.058
Otros activos		469
Total de activos		153.835.293
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(1.294.254)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(6.848)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(2.794)
Otros pasivos		(19.437)
Total de pasivos		(1.323.333)
Total de patrimonio neto		152.511.960

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	3.968,881
Clase AF	100,000
Clase AS	100,000
Clase ASH	53.750,078
Clase AU	24.443,604
Clase DE	5.985,104
Clase IE	7.158,196
Clase IF	100,000
Clase ISH	630,000
Clase IU	13.458,969
Clase XU	3.644.224,576
Clase XUP	9.775.558,080
Clase ZE	107.643,000
Clase ZEH	360,000
Clase ZF	100,000
Clase ZG	100,000
Clase ZU	50.135,906

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	13,3272 ¹	13,82 ¹	13,78 ¹
Clase AF	13,3548 ²	14,25 ²	14,97 ²
Clase AS	9,9395 ³	10,41 ³	11,02 ³
Clase ASH	12,2935 ³	13,21 ³	14,60 ³
Clase AU	12,6814	13,55	14,80
Clase DE	12,8531 ¹	13,38 ¹	13,44 ¹
Clase IE	13,7416 ¹	14,19 ¹	14,03 ¹
Clase IF	13,7594 ²	14,62 ²	15,23 ²
Clase ISH	12,8315 ³	13,72 ³	15,05 ³
Clase IU	13,2033	14,04	15,21
Clase XU [#]	9,8720	—	—
Clase XUP	11,5628	12,51	13,80
Clase ZE	13,7313 ¹	14,19 ¹	14,05 ¹
Clase ZEH	12,0199 ¹	13,00 ¹	14,55 ¹
Clase ZF	13,7639 ²	14,63 ²	15,25 ²
Clase ZG	9,0871 ⁴	9,14 ⁴	—
Clase ZU	13,1884	14,03	15,21

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el período contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del período		185.676.126
Ingreso		
Dividendos, neto	2	3.127.828
Interés bancario	2	33.202
Total de ingresos		3.161.030
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(96.229)
Comisiones bancarias		(522)
Otros gastos operativos	5	(137.817)
Total de gastos		(234.568)
Ingresos netos de inversiones		2.926.462
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(3.368.545)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(9.683)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(50.643)
(Pérdida) neta realizada		(3.428.871)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(9.274.002)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(6.375)
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(9.280.377)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones Valor Liquidativo Total		(9.782.786)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		51.111.889
Reembolsos de acciones		(72.063.788)
Dividendos	7	(2.429.481)
Total de movimientos de capital		(23.381.380)
Patrimonio neto al final del período		152.511.960

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	152.511.960	185.676.126	190.906.857

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	224.580.539
Efectivo en el banco	2	670.443
Por cobrar para la venta de inversiones		1.100.382
Suscripciones por cobrar		30.160
Intereses y dividendos por cobrar, neto		477.232
Otros activos		77
Total de activos		226.858.833
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(196.962)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(219.501)
Impuesto sobre la ganancia de capital no realizado sobre la inversión		(244.902)
Otros pasivos		(24.850)
Total de pasivos		(686.215)
Total de patrimonio neto		226.172.618

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	106,867
Clase IU	24.310,282
Clase ZU	100,000
Clase 1E	1.511.538,600
Clase 1U	26.513.812,432
Clase 2E	9.145.394,551
Clase 2U	2.017.261,816
Clase 3U	1.384.513,010
Clase 8E	474,483
Clase 8U	2.159.495,185
Clase 9U	93.303,441

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ^f	31 de marzo de 2019
Clase IE ^f	10,4363 ¹	—
Clase IU	10,6920	10,72
Clase ZU	10,6881	10,72
Clase 1E	2,6606 ¹	2,60 ¹
Clase 1U	2,9004	2,92
Clase 2E	11,1771 ¹	10,88 ¹
Clase 2U	10,6907	10,72
Clase 3U	2,5671	2,57
Clase 8E	3,0018 ¹	2,92 ¹
Clase 8U	3,2719	3,28
Clase 9U	10,7037	10,72

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es USD.^fConsulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		235.034.331
Ingreso		
Dividendos, neto	2	4.052.445
Interés bancario	2	33.097
Reembolsos de comisiones de gestión de activos	2	1.813
Total de ingresos		4.087.355
Gastos		
Comisión de gestión de activos	5	(1.369.205)
Comisiones bancarias		(410)
Otros gastos operativos	5	(155.046)
Total de gastos		(1.524.661)
Ingresos netos de inversiones		2.562.694
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(838.608)
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		21.935
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(16.408)
(Pérdida) neta realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(749)
(Pérdida) neta realizada		(833.830)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.535.076)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(73.073)
Cambio neto en (pérdida) no realizada		(2.608.149)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones Valor Liquidativo Total		(879.285)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		2.903.479
Reembolsos de acciones		(10.885.907)
Total de movimientos de capital		(7.982.428)
Patrimonio neto al final del periodo		226.172.618

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
USD	226.172.618	235.034.331

Threadneedle (Lux) - Asian Focus*

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	27 de mayo de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE [#]	—	14,49 ¹	14,08 ¹
Clase AF [#]	—	14,83 ²	15,18 ²
Clase AS [#]	—	10,71 ³	11,05 ³
Clase ASH [#]	—	13,88 ³	14,95 ³
Clase AU [#]	—	14,16	15,06
Clase DE [#]	—	14,03 ¹	13,74 ¹
Clase DEH [#]	—	12,54 ¹	13,89 ¹
Clase IE [#]	—	14,87 ¹	14,33 ¹
Clase IF [#]	—	15,22 ²	15,45 ²
Clase ISH [#]	—	14,41 ³	15,39 ³
Clase IU [#]	—	14,71	15,52
Clase XUP [#]	—	14,08	14,75
Clase ZE [#]	—	14,88 ¹	14,35 ¹
Clase ZEH [#]	—	13,62 ¹	14,86 ¹
Clase ZF [#]	—	15,24 ²	15,47 ²
Clase ZG [#]	—	9,40 ⁴	—
Clase ZU [#]	—	14,68	15,51

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

*Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 27 de mayo de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		5.823.895
Ingreso		
Dividendos, neto	2	35.564
Interés bancario	2	1.123
Total de ingresos		36.687
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(7.141)
Otros gastos operativos	5	(1.871)
Total de gastos		(9.012)
Ingresos netos de inversiones		27.675
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		152.674
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.898)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(11)
Ganancia neta realizada		149.765
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(646.973)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		402
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(646.571)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones Valor Liquidativo Total		(469.131)
Movimientos de capital		
Reembolsos de acciones		(5.354.764)
Total de movimientos de capital		(5.354.764)
Patrimonio neto al final del periodo		—

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	27 de mayo de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	—	5.823.895	6.490.902

*Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	10.087.854
Efectivo en el banco	2	385.187
Por cobrar para la venta de inversiones		453.750
Suscripciones por cobrar		1.674
Intereses y dividendos por cobrar, neto		54.877
Otros activos		212
Total de activos		10.983.554
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(58.936)
Reembolsos pagaderos		(509.896)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(80.626)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(15.304)
Otros pasivos		(3.069)
Total de pasivos		(667.831)
Total de patrimonio neto		10.315.723

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	461,560
Clase AEP	4.953,947
Clase AF	100,000
Clase AFP	100,000
Clase ASC	966.659,229
Clase ASH	67.161,674
Clase ASP	100,000
Clase AU	21.827,893
Clase AUP	124.029,295
Clase AVC	99.888,013
Clase AVH	25.593,225
Clase DE	665,397
Clase IE	100,000
Clase IEP	100,000
Clase IF	100,000
Clase IFP	100,000
Clase ISH	630,000
Clase IU	99,997
Clase IUP	100,000
Clase ZE	100,000
Clase ZEH	360,281
Clase ZEP	100,000
Clase ZF	100,000
Clase ZFP	100,000
Clase ZU	4.115,700
Clase ZUP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		16.336.363
Ingreso		
Dividendos, neto	2	386.770
Interés bancario	2	5.475
Total de ingresos		392.245
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(110.320)
Comisiones bancarias		(205)
Otros gastos operativos	5	(22.113)
Total de gastos		(132.638)
Ingresos netos de inversiones		259.607
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(99.905)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(269.624)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(13.593)
(Pérdida) neta realizada		(383.122)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(710.453)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(93.572)
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(804.025)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones Valor Liquidativo Total		(927.540)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.425.962
Reembolsos de acciones		(6.348.576)
Dividendos	7	(170.486)
Total de movimientos de capital		(5.093.100)
Patrimonio neto al final del periodo		10.315.723

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	10.315.723	16.336.363	22.261.222

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	13,290 ¹	13,53 ¹	13,00 ¹
Clase AEP	12,574 ¹	13,18 ¹	13,00 ¹
Clase AF	13,224 ²	13,85 ²	14,02 ²
Clase AFP	12,382 ²	13,35 ²	14,02 ²
Clase ASC	10,139 ³	10,85 ³	11,96 ³
Clase ASH	12,194 ³	12,86 ³	13,70 ³
Clase ASP	10,166 ³	10,61 ³	11,13 ³
Clase AU	12,657 ²	13,27	13,97
Clase AUP	10,582 ⁴	11,27	12,27
Clase AVC	10,076 ⁴	10,81 ⁴	11,86 ⁴
Clase AVH	11,677 ⁴	12,33 ⁴	13,11 ⁴
Clase DE	12,817 ¹	13,10 ¹	12,68 ¹
Clase IE	13,692 ¹	13,88 ¹	13,23 ¹
Clase IEP	12,816 ¹	13,37 ¹	13,23 ¹
Clase IF	13,621 ²	14,20 ²	14,27 ²
Clase IFP	12,600 ²	13,53 ²	14,27 ²
Clase ISH	12,729 ³	13,36 ³	14,12 ³
Clase IU	13,191 ⁶	13,78	14,39
Clase IUP	12,527 ¹	13,47	14,60
Clase ZE	13,703 ¹	13,89 ¹	13,25 ¹
Clase ZEH	11,927 ¹	12,65 ¹	13,65 ¹
Clase ZEP	12,829 ¹	13,39 ¹	13,25 ¹
Clase ZF	13,632 ²	14,22 ²	14,29 ²
Clase ZFP	12,763 ²	13,71 ²	14,29 ²
Clase ZU	13,182 ⁵	13,77	14,39
Clase ZUP	12,534 ⁴	13,48	14,62

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en AUD. La divisa base de la Cartera es el USD.⁶Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	648.337.839
Efectivo en el banco	2	17.009.566
Suscripciones por cobrar		31.508
Intereses y dividendos por cobrar, neto		483.427
Otros activos		71
Total de activos		665.862.411
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(90.437)
Reembolsos pagaderos		(732.127)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.127.794)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(268.531)
Otros pasivos		(127.416)
Total de pasivos		(3.346.305)
Total de patrimonio neto		662.516.106

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEC	7,843
Clase AEH	16.300,933
Clase AU	122.199,909
Clase AUP	9.752,554
Clase DU	3.760,142
Clase IU	5.120.746,021
Clase XS	100,000
Clase XSH	26.917.011,761
Clase ZEH	1.193.787,065
Clase ZFH	200,000
Clase ZGH	200,000
Clase ZU	7.871.171,879

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEC	13,145 ¹	12,75 ¹	12,75 ¹
Clase AEH	20,998 ¹	20,19 ¹	19,80 ¹
Clase AU	37,3190	35,32	33,62
Clase AUP	14,0354	13,41	13,03
Clase DU	18,7656	17,81	17,04
Clase IU	52,9859	49,95	47,16
Clase XS	12,9188 ²	11,87 ²	10,75 ²
Clase XSH	12,9852 ²	12,24 ²	11,57 ²
Clase ZEH	13,4695 ¹	12,89 ¹	12,56 ¹
Clase ZFH	13,2280 ³	12,68 ³	12,39 ³
Clase ZGH	13,9813 ⁴	13,32 ⁴	12,83 ⁴
Clase ZU	14,7073	13,87	13,10

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.⁵Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		607.510.212
Ingreso		
Dividendos, neto	2	4.467.686
Interés bancario	2	157.057
Otros ingresos		1.178
Total de ingresos		4.625.921
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.603.567)
Comisiones bancarias		(690)
Otros gastos operativos	5	(768.701)
Total de gastos		(2.372.958)
Ingresos netos de inversiones		2.252.963
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		12.439.007
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(5.169.847)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		36.196
Ganancia neta realizada		7.305.356
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		25.476.262
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(2.131.436)
Cambio neto en la ganancia no realizada		23.344.826
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		32.903.145
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		113.839.111
Reembolsos de acciones		(91.735.094)
Dividendos	7	(1.268)
Total de movimientos de capital		22.102.749
Patrimonio neto al final del periodo		662.516.106

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	662.516.106	607.510.212	999.062.916

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	6.193.054
Efectivo en el banco	2	50.859
Intereses y dividendos por cobrar, neto		7.185
Total de activos		6.251.098
Pasivos		
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(222)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(2.469)
Otros pasivos		(718)
Total de pasivos		(3.409)
Total de patrimonio neto		6.247.689

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	1.625,544
Clase AEH	175,100
Clase AU	99.600,000
Clase AUP	99.600,000
Clase DE	4.321,678
Clase DEH	175,100
Clase DU	100.615,963
Clase IE	175,100
Clase IEC	175,100
Clase IEH	175,100
Clase IFH	161,100
Clase IG	100,000
Clase IU	99.600,000
Clase ZEH	175,100
Clase ZFH	161,100
Clase ZU	99.600,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	12,6874 ¹	12,11 ¹	10,25 ¹
Clase AEH	11,6283 ¹	11,61 ¹	11,10 ¹
Clase AU	12,4065	12,19	11,31
Clase AUP	11,8522	11,77	11,15
Clase DE	12,6238 ¹	12,06 ¹	10,24 ¹
Clase DEH	11,5735 ¹	11,57 ¹	11,08 ¹
Clase DU	12,3498	12,15	11,29
Clase IE	12,7729 ¹	12,17 ¹	10,28 ¹
Clase IEC	11,1829 ¹	11,26 ¹	10,97 ¹
Clase IEH	11,7121 ¹	11,67 ¹	11,13 ¹
Clase IFH	11,6417 ²	11,61 ²	11,10 ²
Clase IG [#]	10,6481 ³	—	—
Clase IU	12,5065	12,27	11,34
Clase ZEH	11,6924 ¹	11,66 ¹	11,12 ¹
Clase ZFH	11,6063 ²	11,58 ²	11,09 ²
Clase ZU	12,4778	12,25	11,33

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		6.080.103
Ingreso		
Dividendos, neto	2	45.532
Interés bancario	2	14
Total de ingresos		45.546
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(15.047)
Otros gastos operativos	5	(4.386)
Total de gastos		(19.433)
Ingresos netos de inversiones		26.113
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		245.984
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(450)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		26
Ganancia neta realizada		245.560
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(162.796)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(136)
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(162.932)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		108.741
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		72.929
Reembolsos de acciones		(2.210)
Dividendos	7	(11.874)
Total de movimientos de capital		58.845
Patrimonio neto al final del periodo		6.247.689

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	6.247.689	6.080.103	5.642.560

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	202.648.197
Efectivo en el banco	2	778.544
Suscripciones por cobrar		23.353
Intereses y dividendos por cobrar, neto		135.885
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	43.938
Otros activos		543.609
Total de activos		204.173.526
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(236.256)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(160.624)
Otros pasivos		(25.138)
Total de pasivos		(422.018)
Total de patrimonio neto		203.751.508

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	163.782,883
Clase ASH	303.715,860
Clase AUH	39.182,058
Clase DE	172.421,561
Clase IE	97.449,062
Clase W	42.378,438
Clase XE	518.601,999
Clase ZUH	200,000
Clase 1E	3.654.136,074
Clase 1EP	100,000
Clase 1G	231.880,703
Clase 1GP	100,000
Clase 2E	8.157.529,177
Clase 2G	556.244,084
Clase 2U	100,000
Clase 3E	587.202,673
Clase 3G	374.343,692
Clase 3GP	100,000
Clase 4E	836.534,914
Clase 4G	100,000
Clase 8E	455.690,504
Clase 8G	30.305,198
Clase 8U	100,000
Clase 9E	100,000
Clase 9G	100,000
Clase 9GP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		196.368.240
Ingreso		
Dividendos, neto	2	3.665.537
Interés bancario	2	197
Total de ingresos		3.665.734
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.022.276)
Comisiones bancarias		(3.935)
Otros gastos operativos	5	(159.814)
Total de gastos		(1.186.025)
Ingresos netos de inversiones		2.479.709
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		33.444
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		112.423
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(30.172)
Ganancia neta realizada		115.695
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		10.695.123
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(8.449)
Cambio neto en la ganancia no realizada		10.686.674
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		13.282.078
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		18.133.212
Reembolsos de acciones		(24.032.022)
Total de movimientos de capital		(5.898.810)
Patrimonio neto al final del periodo		203.751.508

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
EUR	203.751.508	196.368.240	64.667.911

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	63,3583	59,63	59,61
Clase ASH	17,9107 ¹	16,69 ¹	16,39 ¹
Clase AUH	21,2227 ²	19,69 ²	19,17 ²
Clase BUH	—	—	9,43 ²
Clase DE	22,9792	21,67	21,74
Clase IE	44,1005	41,33	40,97
Clase W	53,2230	50,08	50,04
Clase XE	50,5823	47,21	46,43
Clase ZUH	13,6799 ²	12,65 ²	12,23 ²
Clase 1E	10,0776	9,48	—
Clase 1EP	10,0669	9,47	—
Clase 1G	9,9085 ³	9,08 ³	—
Clase 1GP	9,9024 ³	9,08 ³	—
Clase 2E	10,1505	9,52	—
Clase 2G	9,9795 ³	9,12 ³	—
Clase 2U	9,4721 ²	9,14 ²	—
Clase 3E	10,1648	9,53	—
Clase 3G	9,9939 ³	9,12 ³	—
Clase 3GP	9,9896 ³	9,12 ³	—
Clase 4E	10,2611	9,57	—
Clase 4G	10,0942 ³	9,17 ³	—
Clase 8E	10,1419	9,51	—
Clase 8G	9,9757 ³	9,11 ³	—
Clase 8U	9,4586 ²	9,14 ²	—
Clase 9E	10,1808	9,53	—
Clase 9G	10,0145 ³	9,13 ³	—
Clase 9GP	10,0145 ³	9,13 ³	—

¹La clase está denominada en SGD. La divisa de base de la Cartera es EUR.

²La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.

³La clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	55.980.365
Efectivo en el banco	2	175
Por cobrar para la venta de inversiones		1.294.915
Suscripciones por cobrar		24.802
Intereses y dividendos por cobrar, neto		77.689
Otros activos		261.439
Total de activos		57.639.385
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(1.093.926)
Reembolsos pagaderos		(39.005)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(56.286)
Otros pasivos		(8.039)
Total de pasivos		(1.197.256)
Total de patrimonio neto		56.442.129

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	100,000
Clase AEP	100,000
Clase AUP	100,000
Clase DE	100,000
Clase DEP	100,000
Clase IE	100,000
Clase IEP	3.375,528
Clase ZE	35.037,221
Clase ZEP	100,000
Clase 1E	4.807.614,112
Clase 1EP	13.414.561,808
Clase 1G	195.066,385
Clase 1GP	11.156.090,816
Clase 2E	1.013.929,004
Clase 2EP	4.702,261
Clase 2G	100,000
Clase 2GP	100,000
Clase 3EP	71.668,476
Clase 3G	139.778,239
Clase 3GP	1.271.102,178
Clase 4GP	3.117.488,519
Clase 8E	345.499,001
Clase 8EP	3.137.588,394
Clase 8G	48.848,513
Clase 8GP	433.897,645
Clase 9EP	100,000
Clase 9G	100,000
Clase 9GP	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		59.715.336
Ingreso		
Dividendos, neto	2	1.490.042
Interés bancario	2	46
Total de ingresos		1.490.088
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(354.618)
Comisiones bancarias		(1.520)
Otros gastos operativos	5	(48.737)
Total de gastos		(404.875)
Ingresos netos de inversiones		1.085.213
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		646.066
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		40
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(14.482)
Ganancia neta realizada		631.624
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.081.146
Cambio neto en ganancia no realizada		1.081.146
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		2.797.983
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		1.088.292
Reembolsos de acciones		(6.005.011)
Dividendos	7	(1.154.471)
Total de movimientos de capital		(6.071.190)
Patrimonio neto al final del periodo		56.442.129

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
EUR	56.442.129	59.715.336

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019
Clase AE	10,6672	10,19
Clase AEP	10,2435	10,09
Clase AUP	10,1623 ¹	10,31 ¹
Clase DE	10,6294	10,17
Clase DEP	10,2076	10,07
Clase IE	10,7506	10,23
Clase IEP	10,3230	10,13
Clase ZE	10,7459	10,23
Clase ZEP	10,3196	10,13
Clase 1E	1,7365	1,66
Clase 1EP	1,0145	1,00
Clase 1G	1,5361 ²	1,43 ²
Clase 1GP	0,8980 ²	0,86 ²
Clase 2E	10,7406	10,22
Clase 2EP	10,3249	10,13
Clase 2G	10,8010 ²	10,01 ²
Clase 2GP	10,3742 ²	9,91 ²
Clase 3EP	1,6269	1,60
Clase 3G	1,4633 ²	1,36 ²
Clase 3GP	1,4373 ²	1,38 ²
Clase 4GP	1,2494 ²	1,19 ²
Clase 8E	1,8929	1,80
Clase 8EP	1,0910	1,07
Clase 8G	1,6759 ²	1,55 ²
Clase 8GP	0,9648 ²	0,92 ²
Clase 9EP	10,3458	10,14
Clase 9G	10,8165 ²	10,02 ²
Clase 9GP	10,3909 ²	9,93 ²

¹La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.

²La Clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	537.137.881
Efectivo en el banco	2	218.021
Por cobrar para la venta de inversiones		6.439.213
Suscripciones por cobrar		432.175
Intereses y dividendos por cobrar, neto		245.902
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	132.332
Otros activos		390.016
Total de activos		544.995.540
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(536.296)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(587.918)
Otros pasivos		(141.699)
Total de pasivos		(1.265.913)
Total de patrimonio neto		543.729.627

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	6.519.228,751
Clase ASH	827.135,332
Clase AUH	100,000
Clase DE	1.344.857,561
Clase DUH	100,000
Clase IE	3.546.144,446
Clase W	9.506,605
Clase ZE	3.857.402,233
Clase ZFH	100,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ^a	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	40,2656	37,96	37,79
Clase ASH	27,1332 ¹	25,32 ¹	24,75 ¹
Clase AUH	10,3296 ²	9,61 ²	—
Clase DE	36,7991	34,85	35,01
Clase DUH	10,2118 ²	9,54 ²	—
Clase IE	50,0264	46,99	46,42
Clase W	67,4052	63,57	63,31
Clase ZE	10,0610	9,45	—
Clase ZFH	9,7363 ³	9,16 ³	—

¹La clase está denominada en SGD. La divisa de base de la Cartera es EUR.²La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.³La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es el EUR.^aConsulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		561.444.617
Ingreso		
Dividendos, neto	2	7.936.009
Interés bancario	2	192
Otros ingresos		100
Total de ingresos		7.936.301
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(3.725.153)
Comisiones bancarias		(11.167)
Otros gastos operativos	5	(897.876)
Total de gastos		(4.634.196)
Ingresos netos de inversiones		3.302.105
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		36.517.566
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		302.890
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		36.435
Ganancia neta realizada		36.856.891
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(6.668.850)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(17.379)
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(6.686.229)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		33.472.767
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		76.761.953
Reembolsos de acciones		(127.949.710)
Total de movimientos de capital		(51.187.757)
Patrimonio neto al final del periodo		543.729.627

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
EUR	543.729.627	561.444.617	526.856.473

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.156.736.469
Efectivo en el banco	2	1.102.031
Por cobrar para la venta de inversiones		1.723.845
Suscripciones por cobrar		1.376.618
Intereses y dividendos por cobrar, neto		1.209.020
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	630.810
Otros activos		2.383.736
Total de activos		1.165.162.529
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(414.918)
Reembolsos pagaderos		(2.377.089)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(949.927)
Otros pasivos		(146.095)
Total de pasivos		(3.888.029)
Total de patrimonio neto		1.161.274.500

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	4.275,248
Clase ZE	349.076,415
Clase 1E	36.701.691,556
Clase 1EP	424.898,832
Clase 1FH	206.470,124
Clase 1G	948.261,489
Clase 1UH	3.035.579,812
Clase 2E	13.562.974,913
Clase 2G	100,000
Clase 3E	22.111.481,605
Clase 3EP	1.423.259,157
Clase 3FH	135.331,170
Clase 3G	2.103.419,815
Clase 3GP	19.641,729
Clase 3UH	884.093,268
Clase 4E	6.999.894,927
Clase 4G	2.893.984,671
Clase 8E	11.193.326,037
Clase 8G	537.101,748
Clase 9E	12.463.143,035
Clase 9EP	100,000
Clase 9FH	3.889,660
Clase 9G	937.321,566
Clase 9GP	100,000
Clase 9UH	127.960,456

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.381.828.793
Ingreso		
Dividendos, neto	2	18.038.756
Interés bancario	2	553
Total de ingresos		18.039.309
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(6.228.115)
Comisiones bancarias		(10.351)
Otros gastos operativos	5	(960.500)
Total de gastos		(7.198.966)
Ingresos netos de inversiones		10.840.343
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		15.511.525
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		1.697.094
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(34.910)
Ganancia neta realizada		17.173.709
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		45.210.852
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		109.881
Cambio neto en ganancia no realizada		45.320.733
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		73.334.785
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		98.539.096
Reembolsos de acciones		(392.428.174)
Total de movimientos de capital		(293.889.078)
Patrimonio neto al final del periodo		1.161.274.500

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
EUR	1.161.274.500	1.381.828.793

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019
Clase IE ²	10,1018	—
Clase ZE	9,8428	9,32
Clase 1E	9,7795	9,29
Clase 1EP	9,7424	9,26
Clase 1FH	9,7446 ¹	9,27 ¹
Clase 1G	9,6131 ²	8,90 ²
Clase 1UH	10,0760 ³	9,44 ³
Clase 2E	9,8467	9,33
Clase 2G	9,6813 ²	8,93 ²
Clase 3E	9,8653	9,34
Clase 3EP	9,8272	9,30
Clase 3FH	9,8320 ¹	9,31 ¹
Clase 3G	9,6965 ²	8,94 ²
Clase 3GP	9,6594 ²	8,91 ²
Clase 3UH	10,1612 ³	9,48 ³
Clase 4E	9,9557	9,38
Clase 4G	10,9521 ²	10,05 ²
Clase 8E	9,8444	9,32
Clase 8G	9,6769 ²	8,93 ²
Clase 9E	9,8708	9,34
Clase 9EP	9,8252	9,29
Clase 9FH	9,8364 ¹	9,32 ¹
Clase 9G	9,7041 ²	8,94 ²
Clase 9GP	9,6631 ²	8,90 ²
Clase 9UH	10,1720 ³	9,49 ³

¹La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es EUR.

²La Clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

³La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

⁴Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - European Select

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.418.899.604
Efectivo en el banco	2	1.776.285
Depósitos a plazo	2, 19	10.499.115
Por cobrar para la venta de inversiones		8.422.034
Suscripciones por cobrar		671.917
Intereses y dividendos por cobrar, neto		39.842
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	287.410
Otros activos		3.062.482
Total de activos		1.443.658.689
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(4.591.398)
Reembolsos pagaderos		(768.726)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(1.522.452)
Otros pasivos		(159.240)
Total de pasivos		(7.041.816)
Total de patrimonio neto		1.436.616.873

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	58.532,559
Clase AGH	375,528
Clase AUH	25.036,224
Clase DUH	100,000
Clase IE	1.023.194,682
Clase ZG	6.920,125
Clase ZGH	388.731,845
Clase 1E	81.756.165,295
Clase 1EP	462.173,201
Clase 1SH	2.435.438,004
Clase 1U	54.326,613
Clase 1UH	300.610,517
Clase 2E	11.740.824,990
Clase 2EP	100,000
Clase 3E	6.309.686,610
Clase 3U	549.188,760
Clase 8E	5.413.392,175
Clase 8EP	140.549,551
Clase 9E	12.844.217,081
Clase 9U	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.440.832.024
Ingreso		
Dividendos, neto	2	20.278.136
Interés bancario	2	7.435
Total de ingresos		20.285.571
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(9.452.669)
Comisiones bancarias		(24.647)
Otros gastos operativos	5	(1.002.648)
Total de gastos		(10.479.964)
Ingresos netos de inversiones		9.805.607
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		39.942.884
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		101.130
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		139.942
Ganancia neta realizada		40.183.956
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		71.467.776
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		141.544
Cambio neto en ganancia no realizada		71.609.320
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		121.598.883
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		93.438.731
Reembolsos de acciones		(219.252.765)
Total de movimientos de capital		(125.814.034)
Patrimonio neto al final del periodo		1.436.616.873

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
EUR	1.436.616.873	1.440.832.024	32.938.607

Threadneedle (Lux) - European Select

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ^a	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	24,0568	22,18	21,54
Clase AGH	25,5959 ¹	23,48 ¹	22,60 ¹
Clase AUH	26,4269 ²	24,02 ²	22,72 ²
Clase DUH	11,1857 ²	10,20 ²	—
Clase IE	34,2256	31,41	30,26
Clase ZG	11,9778 ¹	10,71 ¹	10,51 ¹
Clase ZGH	25,9501 ¹	23,71 ¹	22,67 ¹
Clase 1E	11,4377	10,53	—
Clase 1EP	11,4016	10,50	—
Clase 1SH	11,6557 ³	10,63 ³	—
Clase 1U	10,7681 ²	10,21 ²	—
Clase 1UH	11,7639 ²	10,68 ²	—
Clase 2E	11,5017	10,56	—
Clase 2EP	11,4615	10,52	—
Clase 3E	11,5218	10,57	—
Clase 3U	10,8456 ²	10,25 ²	—
Clase 8E	11,4978	10,56	—
Clase 8EP	11,4722	10,54	—
Clase 9E	11,5254	10,57	—
Clase 9U	10,8511 ²	10,25 ²	—

¹La Clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

²La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.

³La clase está denominada en SGD. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

^aConsulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.790.446.869
Efectivo en el banco	2	171.297
Por cobrar para la venta de inversiones		2.858.031
Suscripciones por cobrar		668.341
Intereses y dividendos por cobrar, neto		829.377
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	13.716
Otros activos		2.906.473
Total de activos		1.797.894.104
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(1.778.989)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(1.897.870)
Otros pasivos		(282.358)
Total de pasivos		(3.959.217)
Total de patrimonio neto		1.793.934.887

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IE	100,000
Clase ZE	392.308,582
Clase 1E	108.607.442,607
Clase 1EP	515.766,642
Clase 1FH	43.999,998
Clase 2E	11.901.077,451
Clase 3E	13.311.834,446
Clase 3EP	2.404.942,565
Clase 3FH	174.748,981
Clase 8E	9.285.155,912
Clase 9E	15.694.767,222
Clase 9EP	175.197,000
Clase 9FH	145,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019
Clase IE [#]	9,9283	—
Clase ZE	11,0804	10,64
Clase 1E	11,0174	10,61
Clase 1EP	11,0029	10,60
Clase 1FH	10,9937 ¹	10,60 ¹
Clase 2E	11,0864	10,64
Clase 3E	11,0745	10,62
Clase 3EP	11,0766	10,62
Clase 3FH	11,0781 ¹	10,64 ¹
Clase 8E	11,0843	10,64
Clase 9E	11,1028	10,65
Clase 9EP	11,0824	10,63
Clase 9FH	11,0749 ¹	10,64 ¹

¹La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es EUR.[#]Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el período contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del período		1.875.264.870
Ingreso		
Dividendos, neto	2	24.714.433
Interés bancario	2	2
Total de ingresos		24.714.435
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(12.025.143)
Comisiones bancarias		(17.604)
Otros gastos operativos	5	(1.791.541)
Total de gastos		(13.834.288)
Ingresos netos de inversiones		10.880.147
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		30.916.691
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		78.327
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(5.331)
Ganancia neta realizada		30.989.687
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		31.920.950
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(17.932)
Cambio neto en la ganancia no realizada		31.903.018
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		73.772.852
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		123.238.556
Reembolsos de acciones		(278.341.391)
Total de movimientos de capital		(155.102.835)
Patrimonio neto al final del período		1.793.934.887

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
EUR	1.793.934.887	1.875.264.870

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	57.569.087
Efectivo en el banco	2	969.751
Por cobrar para la venta de inversiones		2.720
Suscripciones por cobrar		326
Intereses y dividendos por cobrar, neto		276.443
Total de activos		58.818.327
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(451.795)
Reembolsos pagaderos		(75)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(13.769)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(17.009)
Impuesto sobre la ganancia de capital no realizado sobre la inversión		(44.219)
Otros pasivos		(9.086)
Total de pasivos		(535.953)
Total de patrimonio neto		58.282.374

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	8.801,763
Clase AU	100.359,164
Clase AUP	668,517
Clase DEH	14.362,204
Clase DU	20.579,144
Clase DUP	357,406
Clase IEP	15.100,000
Clase W	27.803,117
Clase XU	3.428.082,516
Clase XUP	823.502,728
Clase ZG	100,000
Clase ZGH	6.891,198
Clase ZGP	100,000
Clase ZUP	140.941,795

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	34,4986 ¹	35,16 ¹	38,19 ¹
Clase AU	83,7577	84,02	88,46
Clase AUP	10,8011	11,18	12,29
Clase DEH	24,8120 ¹	25,38 ¹	27,78 ¹
Clase DU	41,2362	41,52	44,05
Clase DUP	10,6735	11,09	12,18
Clase IEP	11,1660 ¹	11,17 ¹	10,99 ¹
Clase W	62,2124	62,47	65,90
Clase XU ²	10,3833	—	—
Clase XUP	10,7975	11,08	—
Clase ZG	10,6642 ²	10,08 ²	—
Clase ZGH	19,2395 ²	19,44 ²	20,74 ²
Clase ZGP	10,2233 ²	9,97 ²	—
Clase ZUP	12,2835	12,66	13,69

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La Clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.³Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		60.801.683
Ingreso		
Dividendos, neto	2	1.678.440
Interés bancario	2	13.252
Total de ingresos		1.691.692
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(240.500)
Otros gastos operativos	5	(71.548)
Total de gastos		(312.048)
Ingresos netos de inversiones		1.379.644
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(238.222)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(43.998)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(8.324)
(Pérdida) neta realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(37)
(Pérdida) neta realizada		(290.581)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(1.194.655)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(2.081)
Cambio en la ganancia neta no realizada del impuesto sobre ganancia de capital		27.434
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(1.169.302)
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones Valor Liquidativo Total		(80.239)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		44.537.317
Reembolsos de acciones		(46.639.477)
Dividendos	7	(336.910)
Total de movimientos de capital		(2.439.070)
Patrimonio neto al final del periodo		58.282.374

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	58.282.374	60.801.683	52.527.052

Threadneedle (Lux) - Global Technology

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	256.471.241
Efectivo en el banco	2	4.869.590
Por cobrar para la venta de inversiones		1.744.469
Suscripciones por cobrar		750.728
Intereses y dividendos por cobrar, neto		189.636
Otros activos		278
Total de activos		264.025.942
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(188.713)
Reembolsos pagaderos		(236.368)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(524.752)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(330.297)
Otros pasivos		(64.014)
Total de pasivos		(1.344.144)
Total de patrimonio neto		262.681.798

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	493.021,441
Clase AS	86.569,829
Clase AU	3.113.189,724
Clase AUP	3.686,000
Clase BU	61.975,919
Clase DEH	9.920,199
Clase DU	428.720,558
Clase IEH	771.583,488
Clase IG	100,000
Clase ZEH	35.803,212
Clase ZFH	17.600,000
Clase ZG	100,000
Clase ZU	2.056.212,178

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	37,7599 ¹	35,64 ¹	34,92 ¹
Clase AS	12,9262 ²	11,77 ²	10,82 ²
Clase AU	48,4838	45,07	42,79
Clase AUP	10,8614	10,10	—
Clase BU	61,8166	57,58	54,88
Clase DEH	10,9240 ¹	10,33 ¹	—
Clase DU	71,7239	66,79	63,63
Clase IEH	12,5571 ¹	11,80 ¹	11,45 ¹
Clase IG	11,9678 ³	10,47 ³	—
Clase ZEH	10,4351 ¹	9,81 ¹	—
Clase ZFH	12,2316 ⁴	11,50 ⁴	11,21 ⁴
Clase ZG	11,9595 ³	10,47 ³	—
Clase ZU	21,7439	20,13	18,96

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.⁵Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		240.513.696
Ingreso		
Dividendos, neto	2	852.174
Interés bancario	2	59.990
Total de ingresos		912.164
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.933.979)
Comisiones bancarias		(1.893)
Otros gastos operativos	5	(370.926)
Total de gastos		(2.306.798)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.394.634)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		12.868.895
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.267.694)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(46.971)
Ganancia neta realizada		11.554.230
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		6.616.992
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(206.161)
Cambio neto en la ganancia no realizada		6.410.831
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		16.570.427
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		53.434.582
Reembolsos de acciones		(47.836.907)
Total de movimientos de capital		5.597.675
Patrimonio neto al final del periodo		262.681.798

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	262.681.798	240.513.696	204.409.810

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	264.071.288
Efectivo en el banco	2	80
Suscripciones por cobrar		826.280
Intereses y dividendos por cobrar, neto		587.866
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	89.376
Otros activos		80
Total de activos		265.574.970
Pasivos		
Descubiertos bancarios		(499.264)
Reembolsos pagaderos		(214.685)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(165.485)
Otros pasivos		(37.364)
Total de pasivos		(916.798)
Total de patrimonio neto		264.658.172

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	64.500,584
Clase AFH	100,000
Clase AG	212.243,313
Clase AGP	481.114,528
Clase DEH	100,000
Clase DG	100,000
Clase IEH	37.176,816
Clase IG	1.161.021,689
Clase IGP	1.928.633,425
Clase ZEH	62.905,176
Clase ZFH	2.850,000
Clase ZG	624.950,087
Clase ZGP	1.155.205,087
Clase ZUH	4.081,367
Clase 3EH	1.296.547,669
Clase 3FH	770,000
Clase 3UH	975.869,546
Clase 9EH	1.578.388,550
Clase 9EP	1.986.463,979
Clase 9FH	722.713,165
Clase 9G	4.630.526,073
Clase 9UH	1.637.228,506

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 GBP
Patrimonio neto al inicio del periodo		213.779.407
Ingreso		
Dividendos, neto	2	4.924.418
Interés bancario	2	7.069
Total de ingresos		4.931.487
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(903.035)
Comisiones bancarias		(1.207)
Otros gastos operativos	5	(220.929)
Total de gastos		(1.125.171)
Ingresos netos de inversiones		3.806.316
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.210.012
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		2.398.475
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(14.537)
Ganancia neta realizada		3.593.950
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		5.245.311
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(579.766)
Cambio neto en la ganancia no realizada		4.665.545
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		12.065.811
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		82.867.834
Reembolsos de acciones		(41.856.609)
Dividendos	7	(2.198.271)
Total de movimientos de capital		38.812.954
Patrimonio neto al final del periodo		264.658.172

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
GBP	264.658.172	213.779.407	145.324.124

Threadneedle (Lux) - UK Equities

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	20,6071 ¹	19,80 ¹	19,65 ¹
Clase AFH	10,0566 ²	9,68 ²	9,65 ²
Clase AG	28,5584	27,27	26,70
Clase AGP	22,5184	21,99	22,39
Clase DEH	9,9058 ¹	9,56 ¹	9,57 ¹
Clase DG	10,1757	9,75	9,63
Clase IEH	30,4788 ¹	29,15 ¹	28,64 ¹
Clase IG	40,7718	38,74	37,57
Clase IGP	32,4856	31,51	31,71
Clase ZEH	12,5448 ¹	12,01 ¹	11,83 ¹
Clase ZFH	12,1669 ²	11,66 ²	11,53 ²
Clase ZG	27,1650	25,84	25,11
Clase ZGP	11,7021	11,37	11,46
Clase ZUH	13,3851 ³	12,63 ³	12,09 ³
Clase 3EH	1,7805 ¹	1,70 ¹	—
Clase 3EP [#]	—	1,63 ¹	—
Clase 3FH	1,8733 ²	1,79 ²	—
Clase 3UH	2,1275 ³	2,01 ³	—
Clase 9EH	10,6701 ¹	10,20 ¹	—
Clase 9EP	10,2771 ¹	10,25 ¹	—
Clase 9FH	10,6440 ²	10,19 ²	—
Clase 9G [#]	10,1124	—	—
Clase 9UH	10,9525 ³	10,32 ³	—

¹La clase está denominada en EUR. La divisa de base de la Cartera es la GBP.

²La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el GBP.

³La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es el GBP.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	176.001.365
Efectivo en el banco	2	859.973
Suscripciones por cobrar		133.751
Intereses y dividendos por cobrar, neto		504.420
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	15.808
Total de activos		177.515.317
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(145.600)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(108.790)
Otros pasivos		(29.888)
Total de pasivos		(284.278)
Total de patrimonio neto		177.231.039

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	2.870.183,079
Clase AEC	704,895
Clase AEH	114,600
Clase AG	240.399,700
Clase ASC	175,600
Clase AUC	128,700
Clase DE	2.683,293
Clase DEC	114,600
Clase DEH	114,600
Clase DG	9.198,589
Clase DGP	100,000
Clase IE	837.206,515
Clase IEH	225.627,976
Clase IG	1.485.881,220
Clase IGP	1.116.316,838
Clase IU	133.733,416
Clase IUH	100,000
Clase LG	1.223.755,183
Clase LGP	6.789.844,865
Clase ZE	22.184,822
Clase ZEH	888,103
Clase ZFH	12.494,172
Clase ZG	32.607,700
Clase ZGP	4.812,000
Clase ZUH	14.532,155
Clase 1EH	66.196,311
Clase 1FH	39.381,059
Clase 1UH	68.246,735
Clase 3EH	126.644,394
Clase 3FH	26.371,201
Clase 3UH	275.662,070
Clase 9EH	3.580,888
Clase 9FH	100,000
Clase 9G	1.751.079,452
Clase 9UH	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 GBP
Patrimonio neto al inicio del periodo		139.659.238
Ingreso		
Dividendos, neto	2	3.826.195
Interés bancario	2	12.091
Total de ingresos		3.838.286
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(604.958)
Comisiones bancarias		(130)
Otros gastos operativos	5	(172.349)
Total de gastos		(777.437)
Ingresos netos de inversiones		3.060.849
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		106.523
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		368.642
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(25.971)
Ganancia neta realizada		449.194
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		4.182.582
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(89.174)
Cambio neto en la ganancia no realizada		4.093.408
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		7.603.451
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		58.924.820
Reembolsos de acciones		(27.210.162)
Dividendos	7	(1.746.308)
Total de movimientos de capital		29.968.350
Patrimonio neto al final del periodo		177.231.039

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
GBP	177.231.039	139.659.238	78.477.578

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	10,8947 ¹	10,70 ¹	10,03 ¹
Clase AEC	9,5277 ¹	9,40 ¹	9,61 ¹
Clase AEH	10,5651 ¹	10,18 ¹	9,82 ¹
Clase AG	10,9594	10,49	9,99
Clase ASC	9,7746 ²	9,54 ²	9,91 ²
Clase AUC	10,1112 ³	9,83 ³	9,94 ³
Clase DE	10,6548 ¹	10,51 ¹	9,91 ¹
Clase DEC	9,3022 ¹	9,22 ¹	9,50 ¹
Clase DEH	10,3241 ¹	9,98 ¹	9,71 ¹
Clase DG	10,7213	10,30	9,89
Clase DGP	10,0436	9,88	9,89
Clase IE	11,2033 ¹	10,95 ¹	10,16 ¹
Clase IEH	10,8672 ¹	10,42 ¹	9,96 ¹
Clase IG	11,2928	10,76	10,15
Clase IGP	10,1706	9,92	9,74
Clase IU	10,9036 ³	10,98 ³	11,16 ³
Clase IUH	11,1385 ³	10,52 ³	9,78 ³
Clase LG	11,3382	10,79	10,17
Clase LGP	10,1894	9,92	9,73
Clase ZE	11,1431 ¹	10,91 ¹	10,14 ¹
Clase ZEH	10,8075 ¹	10,37 ¹	9,93 ¹
Clase ZFH	10,6846 ⁴	10,27 ⁴	9,87 ⁴
Clase ZG	11,2161	10,69	10,11
Clase ZGP	10,6244	10,35	10,11
Clase ZUH	11,6004 ³	10,97 ³	10,23 ³
Clase 1EH	10,4296 ¹	10,04 ¹	—
Clase 1FH	10,4047 ⁴	10,03 ⁴	—
Clase 1UH	10,7247 ³	10,18 ³	—
Clase 3EH	10,5059 ¹	10,07 ¹	—
Clase 3FH	10,4784 ⁴	10,06 ⁴	—
Clase 3UH	10,8025 ³	10,21 ³	—
Clase 9EH	10,5040 ¹	10,08 ¹	—
Clase 9FH	10,4748 ⁴	10,06 ⁴	—
Clase 9G [#]	10,0914	—	—
Clase 9UH	10,8021 ³	10,21 ³	—

¹La clase está denominada en EUR. La divisa de base de la Cartera es la GBP.²La clase está denominada en SGD. La divisa de base de la Cartera es la GBP.³La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es la GBP.⁴La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es la GBP.[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	7.505.345
Efectivo en el banco	2	217.763
Intereses y dividendos por cobrar, neto		29.453
Total de activos		7.752.561
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(46.582)
Reembolsos pagaderos		(18.347)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(7.832)
Otros pasivos		(2.193)
Total de pasivos		(74.954)
Total de patrimonio neto		7.677.607

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase IU	1.927.928,431
Clase ZU	49.407,602

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [*]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase IU	3,8828	3,87	4,55
Clase ZU	3,8833	3,87	4,55

^{*}Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		7.921.925
Ingreso		
Dividendos, neto	2	268.843
Interés bancario	2	1.557
Total de ingresos		270.400
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(49.296)
Comisiones bancarias		(49)
Otros gastos operativos	5	(13.803)
Total de gastos		(63.148)
Ingresos netos de inversiones		207.252
(Pérdida) neta realizada en ventas de inversiones		(139.695)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(171)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(9.769)
(Pérdida) neta realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(39)
(Pérdida) neta realizada		(149.674)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(75.045)
Cambio en la ganancia neta no realizada del impuesto sobre ganancia de capital		39.350
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(35.695)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		21.883
Movimientos de capital		
Reembolsos de acciones		(266.201)
Total de movimientos de capital		(266.201)
Patrimonio neto al final del periodo		7.677.607

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	7.677.607	7.921.925	9.735.411

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	102.809.409
Opciones compradas al valor de mercado	2, 12	964.500
Efectivo en el banco	2	5.690.256
Depósitos a plazo	2, 19	77.699.589
Suscripciones por cobrar		68.995
Interés por cobrar en swaps	2	127.796
Intereses y dividendos por cobrar, neto		31.335
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	80.450
Total de activos		187.472.330
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(81.723)
Dividendo pagadero en swaps	2	(145.576)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.026.874)
(Pérdida) neta no realizada en futuros	2, 12	(447.725)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(18.619)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(9)
Otros pasivos		(81.875)
Total de pasivos		(2.802.401)
Total de patrimonio neto		184.669.929

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	69.815,533
Clase AFH	5.890,000
Clase AGH	2.766,812
Clase AU	315.370,276
Clase DEH	20.003,907
Clase DU	121.790,684
Clase IEH	93.442,777
Clase IGH	92.448,862
Clase IU	229.461,632
Clase XGH	13.186.584,007
Clase ZE	100,000
Clase ZEH	100,000
Clase ZGH	12.604,066
Clase ZU	100,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	15,4972 ¹	15,94 ¹	16,26 ¹
Clase AFH	14,1691 ²	14,60 ²	14,95 ²
Clase AGH	16,3852 ³	16,75 ³	16,89 ³
Clase AU	17,0437	17,25	17,10
Clase DEH	12,0985 ¹	12,47 ¹	12,79 ¹
Clase DU	13,2089	13,40	13,35
Clase IEH	22,1708 ¹	22,70 ¹	22,96 ¹
Clase IGH	23,2719 ³	23,69 ³	23,69 ³
Clase IU	24,1405	24,33	23,97
Clase XGH	10,1787 ³	10,32 ³	10,23 ³
Clase ZE	10,6113 ¹	10,40 ¹	—
Clase ZEH	9,6885 ¹	9,92 ¹	—
Clase ZGH	15,9628 ³	16,26 ³	16,27 ³
Clase ZU	10,0720	10,16	—

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.³La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.⁴Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		197.738.046
Ingreso		
Dividendos, neto	2	398.375
Interés bancario	2	930.546
Ingresos por intereses en swaps		433.815
Ingresos por intereses en futuros		14.395
Total de ingresos		1.777.131
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(493.318)
Comisiones de rendimiento	8	(2)
Comisiones bancarias		(4.761)
Dividendos pagados en swaps		(244.092)
Gastos por intereses en swaps		(173.888)
Otros gastos operativos	5	(193.020)
Total de gastos		(1.109.081)
Ingresos netos de inversiones		668.050
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.914.932
(Pérdida) neta realizada en swaps		(1.713.478)
(Pérdida) neta realizada en opciones		(1.068.126)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(13.183.540)
(Pérdida) neta realizada en futuros		(4.002.412)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(30.214)
(Pérdida) neta realizada		(18.082.838)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(652.165)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		181.606
Cambio en la ganancia neta no realizada sobre opciones		722.881
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		1.590.413
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		2.813.625
Cambio neto en ganancia no realizada		4.656.360
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(12.758.428)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		115.437.744
Reembolsos de acciones		(115.747.433)
Total de movimientos de capital		(309.689)
Patrimonio neto al final del periodo		184.669.929

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	184.669.929	197.738.046	222.720.376

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	1.595.695.703
Efectivo en el banco	2	53.884.829
Depósitos a plazo	2, 19	87.216.067
Suscripciones por cobrar		456.997
Interés por cobrar en swaps	2	27.396
Intereses y dividendos por cobrar, neto		16.893.615
Pago por adelantado abonado en transacciones swap	2	1.356.514
Ganancia neta no realizada en futuros	2, 12	237.880
Otros activos		482
Total de activos		1.755.769.483
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(25.643.522)
Reembolsos pagaderos		(5.202.972)
Interés pagadero en swaps	2	(511.144)
Pago por adelantado cobrado en transacciones de swap	2	(1.165.610)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(4.928.324)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(23.004.047)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(795.471)
Otros pasivos		(128.779)
Total de pasivos		(61.379.869)
Total de patrimonio neto		1.694.389.614

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase ZE	554.039,009
Clase 1E	22.403.793,932
Clase 1EP	151.358,872
Clase 1GH	275.841,999
Clase 1UH	781.856,625
Clase 2E	76.987.357,771
Clase 2EP	100,000
Clase 2GC	100,000
Clase 2GH	16.213,398
Clase 4GH	242.133,138
Clase 8E	48.964.146,339
Clase 8EP	5.104.154,630
Clase 8GC	93.416,782
Clase 8GH	11.655.737,632

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		1.710.173.003
Ingreso		
Dividendos, neto	2	237.960
Interés sobre bonos, neto	2	29.303.052
Interés bancario	2	36.694
Ingresos por intereses en swaps		715.875
Ingresos por intereses en futuros		9
Total de ingresos		30.293.590
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(4.924.065)
Comisiones bancarias		(115.586)
Gastos por intereses en swaps		(9.378.714)
Gastos por intereses en futuros		(300.382)
Otros gastos operativos	5	(801.015)
Total de gastos		(15.519.762)
Ingresos netos de inversiones		14.773.828
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		8.784.983
(Pérdida) neta realizada en swaps		(6.278.766)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(7.404.768)
(Pérdida) neta realizada en futuros		(40.279.769)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		446.806
(Pérdida) neta realizada		(44.731.514)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		29.728.182
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		4.892.417
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(5.621.746)
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		10.728.194
Cambio neto en ganancia no realizada		39.727.047
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		9.769.361
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		253.257.674
Reembolsos de acciones		(278.810.424)
Total de movimientos de capital		(25.552.750)
Patrimonio neto al final del periodo		1.694.389.614

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
EUR	1.694.389.614	1.710.173.003

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019
Clase ZE	10,0168	9,95
Clase 1E	9,9797	9,93
Clase 1EP	9,7781	9,73
Clase 1GH	10,0944 ¹	9,99 ¹
Clase 1UH	10,2834 ²	10,08 ²
Clase 2E	10,0468	9,96
Clase 2EP	9,8148	9,73
Clase 2GC	9,9193 ¹	9,78 ¹
Clase 2GH	10,1617 ¹	10,02 ¹
Clase 4GH	10,2187 ¹	10,05 ¹
Clase 8E	10,0384	9,96
Clase 8EP	9,8702	9,79
Clase 8GC	9,9703 ¹	9,83 ¹
Clase 8GH	10,1587 ¹	10,02 ¹

¹La Clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

²La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	84.542.596
Efectivo en el banco	2	4.100.211
Depósitos a plazo	2, 19	4.798.756
Por cobrar para la venta de inversiones		132.064
Suscripciones por cobrar		16.384
Interés por cobrar en swaps	2	2.699
Intereses y dividendos por cobrar, neto		617.175
Pago por adelantado abonado en transacciones swap	2	265.008
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	95.756
Ganancia neta no realizada en futuros	2, 12	53.428
Otros activos		4.863
Total de activos		94.628.940
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(5.436.398)
Reembolsos pagaderos		(61.416)
Interés pagadero en swaps	2	(21.703)
Pago por adelantado cobrado en transacciones swap	2	(80.942)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.145.224)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(21.444)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(11)
Otros pasivos		(14.382)
Total de pasivos		(6.781.520)
Total de patrimonio neto		87.847.420

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	100,002
Clase AFH	189,200
Clase AKH	100,000
Clase ANH	1.000,000
Clase AUH	100,000
Clase DE	602,715
Clase IE	373.830,623
Clase IEP	99,999
Clase IGH	3.909.765,778
Clase IU	100,000
Clase IUH	868.047,595
Clase JE	99,997
Clase JGH	140,800
Clase JUH	100,000
Clase LE	2.726.079,001
Clase LEP	256.627,320
Clase LGH	140,800
Clase YE	100,001
Clase YGH	140,800
Clase YUH	100,000
Clase ZE	99,997
Clase ZFH	20.189,200
Clase ZGH	140,800
Clase ZUH	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		50.389.420
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	866.002
Interés bancario	2	6.254
Ingresos por intereses en swaps		36.844
Total de ingresos		909.100
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(117.381)
Comisiones de rendimiento	8	(6)
Comisiones bancarias		(14.923)
Gastos por intereses en swaps		(241.563)
Gastos por intereses en futuros		(12.202)
Otros gastos operativos	5	(76.436)
Total de gastos		(462.511)
Ingresos netos de inversiones		446.589
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		419.593
Ganancia neta realizada en swaps		958.818
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(1.636.341)
(Pérdida) neta realizada en futuros		(1.969.862)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		25.870
(Pérdida) neta realizada		(2.201.922)
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		1.820.302
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(1.114.409)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		396.679
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		393.673
Cambio neto en ganancia no realizada		1.496.245
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(259.088)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		42.786.107
Reembolsos de acciones		(5.038.468)
Dividendos	7	(30.551)
Total de movimientos de capital		37.717.088
Patrimonio neto al final del periodo		87.847.420

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
EUR	87.847.420	50.389.420	4.029.085

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	10,0139	9,96	10,00
Clase AFH	9,9459 ¹	9,92 ¹	10,00 ¹
Clase AKH [#]	99,7459 ²	—	—
Clase ANH [#]	10,0135 ³	—	—
Clase AUH	10,4428 ⁴	10,24 ⁴	9,99 ⁴
Clase DE	9,9215	9,90	10,00
Clase IE	10,1066	10,02	10,00
Clase IEP	9,6836	9,72	10,00
Clase IGH	10,2642 ⁵	10,12 ⁵	10,00 ⁵
Clase IU [#]	9,7720 ⁴	—	—
Clase IUH	10,5270 ⁴	10,29 ⁴	9,99 ⁴
Clase JE	10,1147	10,03	10,00
Clase JGH	10,2780 ⁵	10,14 ⁵	10,00 ⁵
Clase JUH	10,5023 ⁴	10,29 ⁴	9,99 ⁴
Clase LE	10,1298	10,03	10,00
Clase LEP	9,7395	9,77	10,00
Clase LGH	10,2910 ⁵	10,14 ⁵	10,00 ⁵
Clase YE	10,0970	10,02	10,00
Clase YGH	10,2532 ⁵	10,12 ⁵	10,00 ⁵
Clase YUH	10,4831 ⁴	10,27 ⁴	9,99 ⁴
Clase ZE	10,0847	10,01	10,00
Clase ZFH	10,0114 ¹	9,96 ¹	10,00 ¹
Clase ZGH	10,2573 ⁵	10,12 ⁵	10,00 ⁵
Clase ZUH	10,5154 ⁴	10,28 ⁴	9,99 ⁴

¹La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es EUR.

²La clase está denominada en SEK. La divisa de base de la Cartera es EUR.

³La clase está denominada en NOK. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

⁴La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

⁵La clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	104.268.590
Efectivo en el banco	2	4.667.526
Por cobrar para la venta de inversiones		5.721.488
Suscripciones por cobrar		1.397.152
Interés por cobrar en swaps	2	883.711
Intereses y dividendos por cobrar, neto		59.009
Ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	357.146
Otros activos		70.458
Total de activos		117.425.080
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(9.341.544)
Reembolsos pagaderos		(44.115)
Interés pagadero en swaps	2	(3.672.796)
Dividendo pagadero en swaps	2	(160.517)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(379.144)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(25.698)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(266.559)
Otros pasivos		(14.923)
Total de pasivos		(13.905.296)
Total de patrimonio neto		103.519.784

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AE	592.604,950
Clase AEP	200,000
Clase AUH	200,000
Clase DE	432.229,385
Clase IE	794.587,788
Clase IGH	96.568,577
Clase LE	510.988,591
Clase XGH	4.909.146,621
Clase ZE	111.772,903
Clase ZF	100,000
Clase ZFH	100,000
Clase ZGH	200,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AE	11,8163	10,93	9,94
Clase AEP	12,1228	11,06	9,93
Clase AUH	12,3849 ¹	11,38 ¹	10,20 ¹
Clase DE	11,6372	10,78	9,86
Clase IE	12,1162	11,08	10,07
Clase IGH	12,2846 ²	11,27 ²	10,17 ²
Clase LE	12,2085	11,23	10,11
Clase XGH	13,1407 ²	11,81 ²	10,33 ²
Clase ZE	12,1082	11,14	10,05
Clase ZF	11,6499 ³	11,04 ³	10,49 ³
Clase ZFH	11,5473 ³	10,72 ³	—
Clase ZGH	12,2082 ²	11,24 ²	10,15 ²

¹La clase está denominada en USD. La divisa de base de la Cartera es EUR.²La clase está denominada en GBP. La divisa de base de la Cartera es el EUR.³La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es el EUR.⁴Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 EUR
Patrimonio neto al inicio del periodo		62.685.309
Ingreso		
Dividendos, neto	2	940.385
Interés bancario	2	1.551
Ingresos por intereses en swaps		75.744
Ingresos por intereses en futuros		45
Otros ingresos		22.459
Total de ingresos		1.040.184
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(109.133)
Comisiones de rendimiento	8	(139.663)
Comisiones bancarias		(8.029)
Dividendos pagados en swaps		(1.248.085)
Gastos por intereses en swaps		(137.793)
Gastos por intereses en futuros		(45)
Otros gastos operativos	5	(76.251)
Comisiones varias	4	(1.687)
Total de gastos		(1.720.686)
Ingresos netos de inversiones		(680.502)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		9.927.038
(Pérdida) neta realizada en swaps		(237.413)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(2.126.338)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		36.297
Ganancia neta realizada		7.599.584
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(609.514)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(611.290)
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		924.415
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(296.389)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		6.622.693
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		41.523.593
Reembolsos de acciones		(7.311.811)
Total de movimientos de capital		34.211.782
Patrimonio neto al final del periodo		103.519.784

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
EUR	103.519.784	62.685.309	45.413.612

Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 GBP
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	8.310.855
Efectivo en el banco	2	520.074
Depósitos a plazo	2, 19	1.102.187
Suscripciones por cobrar		6
Interés por cobrar en swaps	2	7.983
Intereses y dividendos por cobrar, neto		7.418
Total de activos		9.948.523
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(900)
Reembolsos pagaderos		(20.704)
Interés pagadero en swaps	2	(18.591)
Dividendo pagadero en swaps	2	(14.780)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(33.464)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(33.518)
(Pérdida) neta no realizada en futuros	2, 12	(10.530)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(10.143)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(52)
Otros pasivos		(1.314)
Total de pasivos		(143.996)
Total de patrimonio neto		9.804.527

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	100,000
Clase AG	100,000
Clase DEH	100,000
Clase DG	100,000
Clase IG	100,000
Clase ZG	100,000
Clase 1E	1.702.675,251
Clase 1EH	1.906.472,632
Clase 2E	100,000
Clase 2EH	100,000
Clase 3EH	156.563,216
Clase 3FH	69.876,000
Clase 8E	872.395,163
Clase 8EH	2.894.288,864
Clase 9EH	100,000
Clase 9FH	100,000

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 GBP
Patrimonio neto al inicio del periodo		15.636.041
Ingreso		
Dividendos, neto	2	149.971
Interés sobre bonos, neto	2	9.726
Interés bancario	2	7.615
Ingresos por intereses en swaps		9.606
Ingresos por intereses en futuros		172
Total de ingresos		177.090
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(76.134)
Comisiones de rendimiento	8	(9.723)
Comisiones bancarias		(154)
Dividendos pagados en swaps		(51.909)
Gastos por intereses en swaps		(5.725)
Otros gastos operativos	5	(8.674)
Total de gastos		(152.319)
Ingresos netos de inversiones		24.771
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		373.661
Ganancia neta realizada en swaps		32.356
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		433.533
(Pérdida) neta realizada en futuros		(125.791)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		43.245
Ganancia neta realizada		757.004
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(16.911)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(50.759)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(172.920)
Cambio en la ganancia neta no realizada en futuros		42.931
Cambio neto en la (pérdida) no realizada		(197.659)
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		584.116
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		122.244
Reembolsos de acciones		(6.537.874)
Total de movimientos de capital		(6.415.630)
Patrimonio neto al final del periodo		9.804.527

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
GBP	9.804.527	15.636.041

Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019
Clase AEH	10,2632 ¹	10,14 ¹
Clase AG	10,3443	10,17
Clase DEH	10,2377 ¹	10,14 ¹
Clase DG	10,3096	10,16
Clase IG	10,3902	10,18
Clase ZG	10,3880	10,18
Clase 1E	1,5004 ¹	1,51 ¹
Clase 1EH	1,3444 ¹	1,32 ¹
Clase 2E	10,1707 ¹	10,22 ¹
Clase 2EH	10,2984 ¹	10,14 ¹
Clase 3EH	1,3294 ¹	1,30 ¹
Clase 3FH	1,4164 ²	1,39 ²
Clase 8E	1,5648 ¹	1,57 ¹
Clase 8EH	1,4821 ¹	1,46 ¹
Clase 9EH	10,3087 ¹	10,15 ¹
Clase 9FH	10,2987 ²	10,15 ²

¹La clase está denominada en EUR. La divisa de base de la Cartera es la GBP.

²La clase está denominada en CHF. La divisa de base de la Cartera es la GBP.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	110.280.479
Efectivo en el banco	2	861.043
Depósitos a plazo	2, 19	911.907
Suscripciones por cobrar		41.365
Interés por cobrar en swaps	2	66.346
Intereses y dividendos por cobrar, neto		34.022
Otros activos		106
Total de activos		112.195.268
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(79.599)
Dividendo pagadero en swaps	2	(72.102)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(59.990)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(21.712)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(117.555)
Otros pasivos		(15.662)
Total de pasivos		(366.620)
Total de patrimonio neto		111.828.648

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	264,813
Clase AU	100,000
Clase DEH	100,000
Clase DU	100,000
Clase IU	135.740,000
Clase ZU	100,000
Clase 1E	5.338.504,954
Clase 1EH	860.201,384
Clase 1U	7.824.067,068
Clase 2E	100,000
Clase 2U	100,000
Clase 3U	48.800,000
Clase 8E	405.934,543
Clase 8U	5.059.754,924
Clase 9U	100,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ^f	31 de marzo de 2019
Clase AEH	10,5310 ¹	10,31 ¹
Clase AU	10,7554	10,36
Clase DEH	10,4940 ¹	10,30 ¹
Clase DU	10,7126	10,35
Clase IU	10,8237	10,38
Clase ZU	10,8075	10,38
Clase 1E	5,1074 ¹	4,77 ¹
Clase 1EH	3,8266 ¹	3,74 ¹
Clase 1U	5,5671	5,36
Clase 2E	11,3195 ¹	10,54 ¹
Clase 2U	10,8287	10,38
Clase 3U	3,1076	2,98
Clase 8E	5,5636 ¹	5,18 ¹
Clase 8U	6,0998	5,82
Clase 9U	10,8277	10,38

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.^fConsulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		130.515.247
Ingreso		
Dividendos, neto	2	392.326
Interés bancario	2	42.556
Ingresos por intereses en swaps		263.795
Ingresos por intereses en futuros		2.329
Otros ingresos		140.859
Total de ingresos		841.865
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(755.590)
Comisiones bancarias		(878)
Dividendos pagados en swaps		(47.335)
Gastos por intereses en swaps		(400.302)
Gastos por intereses en futuros		(1.578)
Otros gastos operativos	5	(100.270)
Total de gastos		(1.305.953)
(Pérdida) neta de inversiones		(464.088)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		1.199.983
Ganancia neta realizada en swaps		1.111.313
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(157.346)
Ganancia neta realizada en futuros		173.011
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(5.831)
Ganancia neta realizada		2.321.130
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		3.189.613
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		143.029
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(8.884)
Cambio neto en la ganancia no realizada		3.323.758
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		5.180.800
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		8.393.336
Reembolsos de acciones		(32.260.735)
Total de movimientos de capital		(23.867.399)
Patrimonio neto al final del periodo		111.828.648

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
USD	111.828.648	130.515.247

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	168.975.072
Efectivo en el banco	2	698.746
Depósitos a plazo	2, 19	9.390.690
Por cobrar para la venta de inversiones		5.029.124
Suscripciones por cobrar		28.560
Interés por cobrar en swaps	2	116.212
Intereses y dividendos por cobrar, neto		137.680
Otros activos		7.314
Total de activos		184.383.398
Pasivos		
Pagadero por inversiones adquiridas		(2.820.467)
Reembolsos pagaderos		(52.583)
Dividendo pagadero en swaps	2	(79.977)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(2.535)
(Pérdida) neta no realizada en swaps	2, 10	(1.706.459)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(191.911)
Comisiones de rendimiento pagaderas	8	(472.636)
Impuesto sobre la ganancia de capital no realizado sobre la inversión		(179.779)
Otros pasivos		(26.113)
Total de pasivos		(5.532.460)
Total de patrimonio neto		178.850.938

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	20.100,000
Clase AU	8.977,627
Clase DEH	100,000
Clase DU	100,000
Clase IU	322.519,673
Clase ZU	100,000
Clase 1E	27.914.035,745
Clase 1U	1.595.566,604
Clase 2E	44.054,110
Clase 2U	3.771.720,924
Clase 8E	987.231,815
Clase 8U	288.092,740

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 ¹	31 de marzo de 2019
Clase AEH	11,0805 ¹	10,74 ¹
Clase AU	11,2930	10,79
Clase DEH	11,1303 ¹	10,73 ¹
Clase DU	11,3124	10,78
Clase IU	11,3783	10,80
Clase ZU	11,3928	10,80
Clase 1E	3,8981 ¹	3,58 ¹
Clase 1U	4,2504	4,02
Clase 2E	11,8977 ¹	10,94 ¹
Clase 2U	11,3900	10,78
Clase 8E	4,2362 ¹	3,89 ¹
Clase 8U	4,6351	4,37

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.²Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		170.492.979
Ingreso		
Dividendos, neto	2	977.591
Interés bancario	2	150.865
Ingresos por intereses en swaps		423.500
Total de ingresos		1.551.956
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(1.155.267)
Comisiones de rendimiento	8	(271.611)
Comisiones bancarias		(146)
Dividendos pagados en swaps		(287.044)
Gastos por intereses en swaps		(864.713)
Otros gastos operativos	5	(144.719)
Total de gastos		(2.723.500)
(Pérdida) neta de inversiones		(1.171.544)
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		3.917.290
Ganancia neta realizada en swaps		6.017.237
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(523)
Ganancia neta realizada de cambio de divisas		24.888
(Pérdida) neta realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(579)
Ganancia neta realizada		9.958.313
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		3.161.863
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en swaps		(2.396.887)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en futuros		(2.511)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada del impuesto sobre ganancia de capital		(69.845)
Cambio neto en la ganancia no realizada		692.620
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		9.479.389
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		29.007.649
Reembolsos de acciones		(30.129.079)
Total de movimientos de capital		(1.121.430)
Patrimonio neto al final del periodo		178.850.938

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019
USD	178.850.938	170.492.979

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	366.928.350
Efectivo en el banco	2	13.802.390
Suscripciones por cobrar		3.232.098
Intereses y dividendos por cobrar, neto		32.891
Ganancia neta no realizada en swaps	2, 10	5.114.731
Otros activos		3.712
Total de activos		389.114.172
Pasivos		
Reembolsos pagaderos		(73.685)
Interés pagadero en swaps	2	(57.452)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en contratos de divisas a plazo	2, 9	(1.186.893)
Comisión de gestión de activos pagadera	5	(134.365)
Otros pasivos		(57.649)
Total de pasivos		(1.510.044)
Total de patrimonio neto		387.604.128

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AEH	293.214,887
Clase AFH	148.361,729
Clase AGH	32.138,210
Clase ASH	1.283.388,797
Clase AU	886.890,671
Clase DEH	282.176,846
Clase DU	171.958,946
Clase IEH	398.610,347
Clase IFH	25.000,000
Clase IG	100,000
Clase IGH	5.526.477,175
Clase IU	3.581.674,267
Clase NG	3.820.539,918
Clase XU	13.078.996,118
Clase ZEH	65.450,000
Clase ZFH	6.510,000
Clase ZGH	86.247,631
Clase ZU	51.245,074

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el período contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		446.269.011
Ingreso		
Interés sobre bonos, neto	2	7.273.186
Interés bancario	2	168.421
Ingresos por intereses en swaps		12.787
Total de ingresos		7.454.394
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(897.406)
Comisiones bancarias		(14.787)
Gastos por intereses en swaps		(391.487)
Otros gastos operativos	5	(381.813)
Total de gastos		(1.685.493)
Ingresos netos de inversiones		5.768.901
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		163.294
(Pérdida) neta realizada en swaps		(21.260.774)
(Pérdida) neta realizada en contratos de divisas a plazo		(7.218.040)
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(44.523)
(Pérdida) neta realizada		(28.360.043)
Cambio en la (pérdida) neta no realizada en inversiones		(2.343.413)
Cambio en la ganancia neta no realizada en swaps		6.806.974
Cambio en la ganancia neta no realizada en contratos de divisas a plazo		758.996
Cambio neto en ganancia no realizada		5.222.557
(Disminución) neta en el patrimonio neto como resultado de operaciones		(17.368.585)
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		26.721.263
Reembolsos de acciones		(68.017.561)
Total de movimientos de capital		(41.296.298)
Patrimonio neto al final del periodo		387.604.128

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	387.604.128	446.269.011	551.347.892

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [#]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AEH	8,0664 ¹	8,48 ¹	9,62 ¹
Clase AFH	5,9791 ²	6,30 ²	7,17 ²
Clase AGH	8,5932 ³	8,98 ³	10,07 ³
Clase ASH	4,4606 ⁴	4,63 ⁴	5,15 ⁴
Clase AU	9,2657	9,58	10,54
Clase DEH	6,1703 ¹	6,50 ¹	7,42 ¹
Clase DU	7,0894	7,35	8,13
Clase IEH	11,6779 ¹	12,21 ¹	13,72 ¹
Clase IFH	8,6480 ²	9,06 ²	10,21 ²
Clase IG	10,2720 ³	10,00 ³	—
Clase IGH	12,4152 ³	12,90 ³	14,32 ³
Clase IKH	—	—	105,98 ⁵
Clase IU	13,4020	13,79	15,01
Clase NG	9,8144 ³	9,53 ³	—
Clase XU	13,9801	14,32	15,46
Clase ZEH	4,9368 ¹	5,16 ¹	5,81 ¹
Clase ZFH	4,7956 ²	5,02 ²	5,66 ²
Clase ZGH	7,1154 ³	7,40 ³	8,22 ³
Clase ZU	5,5318	5,69	6,20

¹La clase está denominada en EUR. La divisa base de la Cartera es el USD.

²La clase está denominada en CHF. La divisa base de la Cartera es el USD.

³La clase está denominada en GBP. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁴La clase está denominada en SGD. La divisa base de la Cartera es el USD.

⁵La clase está denominada en SEK. La divisa base de la Cartera es el USD.

[#]Consulte la nota 1.

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

ESTADO DEL PATRIMONIO NETO

a 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Activos		
Cartera de inversión al valor del mercado	2	12.756.096
Efectivo en el banco	2	271.239
Suscripciones por cobrar		55
Dividendos netos por cobrar		14.949
Otros activos		3.835
Total de activos		13.046.174
Pasivos		
Comisiones de gestión de activos pagaderas	5	(8.285)
Otros pasivos		(3.224)
Total de pasivos		(11.509)
Total de patrimonio neto		13.034.665

NÚMERO DE ACCIONES EN CIRCULACIÓN

Clase AU	547.331,512
Clase XU	500.000,000

ESTADO DE LOS VALORES LIQUIDATIVOS POR ACCIÓN

	30 de septiembre de 2019 [*]	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
Clase AU	12,3060	11,56	11,53
Clase XU	12,5985	11,74	11,52

^{*}Consulte la nota 1.

ESTADO DE OPERACIONES Y VARIACIONES EN EL PATRIMONIO NETO

para el periodo contable del 01 de abril de 2019 al 30 de septiembre de 2019

	Notas	2019 USD
Patrimonio neto al inicio del periodo		12.383.414
Ingreso		
Dividendos, neto	2	95.168
Total de ingresos		95.168
Gastos		
Comisiones de gestión de activos	5	(50.170)
Otros gastos operativos	5	(19.443)
Comisiones varias	4	(1.104)
Total de gastos		(70.717)
Ingresos netos de inversiones		24.451
Ganancia neta realizada en ventas de inversiones		117.163
Ganancia neta realizada en contratos de divisas a plazo		32
(Pérdida) neta realizada de cambio de divisas		(1.300)
Ganancia neta realizada		115.895
Cambio en la ganancia neta no realizada en inversiones		694.013
Cambio neto en ganancia no realizada		694.013
Aumento neto en el patrimonio neto como resultado de operaciones		834.359
Movimientos de capital		
Suscripciones de acciones		112.337
Reembolsos de acciones		(295.445)
Total de movimientos de capital		(183.108)
Patrimonio neto al final del periodo		13.034.665

VALOR LIQUIDATIVO TOTAL

	30 de septiembre de 2019	31 de marzo de 2019	31 de marzo de 2018
USD	13.034.665	12.383.414	11.522.282

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
AUSTRALIA					FRANCIA (continuación)				
USD	1.247.000	APT Pipelines Limited 4.20% 23/03/2025	1.324.365	0,61	EUR	1.000.000	HSBC France SA 0.10% 03/09/2027	1.079.587	0,50
EUR	640.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	809.883	0,37	EUR	2.000.000	Orange SA 0.00% 04/09/2026	2.151.179	1,00
USD	1.545.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.692.035	0,78			Total de Francia	10.756.419	5,00
EUR	890.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.016.444	0,47	ALEMANIA				
USD	1.415.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	1.485.602	0,69	EUR	1.000.000	ADLER Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.109.507	0,51
		Total de Australia	6.328.329	2,92	EUR	400.000	ADLER Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	462.743	0,21
BÉLGICA					EUR	1.000.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.079.767	0,50
EUR	400.000	KBC Group NV Perp FRN	466.544	0,22	EUR	1.344.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	1.519.955	0,70
		Total de Bélgica	466.544	0,22	EUR	1.527.000	Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	1.717.865	0,79
BERMUDAS					EUR	1.100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	1.176.798	0,54
USD	1.480.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	1.698.277	0,78			Total de Alemania	7.066.635	3,25
		Total de Bermudas	1.698.277	0,78	INDIA				
ISLAS CAIMÁN					USD	430.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	400.063	0,18
USD	532.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	579.253	0,27			Total de India	400.063	0,18
USD	101.000	Noble Holding International Limited 8.95% 01/04/2045	51.636	0,02	IRLANDA				
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	214.680	0,10	EUR	1.155.000	AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	1.353.526	0,62
GBP	534.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Limited 2.38% 03/05/2023	665.593	0,31	USD	610.000	Bank of Ireland Group plc 4.50% 25/11/2023	640.302	0,30
		Total de Islas Caimán	1.511.162	0,70	EUR	499.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	584.531	0,27
FINLANDIA					USD	2.125.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	2.235.529	1,04
EUR	362.000	Sampo Oyj FRN 23/05/2049	446.305	0,21	EUR	790.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	968.936	0,45
		Total de Finlandia	446.305	0,21			Total de Irlanda	5.782.824	2,68
FRANCIA					ITALIA				
EUR	2.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	2.371.263	1,10	EUR	375.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	480.306	0,22
EUR	1.900.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	2.209.740	1,03	EUR	375.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	416.189	0,19
USD	903.000	Credit Agricole SA Perp FRN	975.631	0,45					
EUR	1.700.000	Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	1.969.019	0,92					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ITALIA (continuación)					PAÍSES BAJOS (continuación)				
EUR	951.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	1.064.043	0,49	EUR	563.000	TenneT Holding BV Perp FRN	657.093	0,31
EUR	808.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	881.877	0,41	EUR	500.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	713.956	0,33
Total de Italia			2.842.415	1,31	Total de Países Bajos			10.119.979	4,68
JAPÓN					NORUEGA				
EUR	991.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.55% 06/11/2023	1.116.019	0,52	EUR	1.625.000	DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	1.790.674	0,83
Total de Japón			1.116.019	0,52	Total de Noruega			1.790.674	0,83
LUXEMBURGO					ESPAÑA				
EUR	885.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	997.019	0,46	EUR	500.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 18/01/2029	588.301	0,27
EUR	1.727.000	Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	1.969.569	0,91	EUR	700.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	819.144	0,38
EUR	300.000	CPI Property Group SA 2.13% 04/10/2024	346.367	0,16	EUR	1.200.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	1.363.551	0,63
EUR	934.000	DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	1.021.920	0,48	EUR	600.000	Caixabank SA FRN 17/04/2030	673.809	0,31
EUR	503.000	DH Europe Finance II Sarl 0.75% 18/09/2031	551.453	0,25	EUR	1.627.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.926.549	0,89
EUR	800.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	909.489	0,42	Total de España			5.371.354	2,48
EUR	500.000	Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	575.524	0,27	SUECIA				
EUR	273.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 02/07/2031	310.219	0,14	EUR	1.620.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	1.862.400	0,85
Total de Luxemburgo			6.681.560	3,09	EUR	1.297.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	1.483.262	0,69
MÉXICO					Total de Suecia			3.345.662	1,54
EUR	438.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	480.412	0,22	SUIZA				
USD	536.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	558.627	0,26	USD	330.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	365.870	0,17
Total de México			1.039.039	0,48	USD	950.000	UBS Group Funding Perp FRN	892.406	0,41
PAÍSES BAJOS					USD	768.000	UBS Group Funding Perp FRN	818.112	0,38
EUR	918.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	1.024.732	0,47	Total de Suiza			2.076.388	0,96
EUR	1.317.000	Enaxis Holding NV 0.75% 02/07/2031	1.489.977	0,69	REINO UNIDO				
GBP	1.882.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.234.601	1,50	EUR	950.000	British Telecommunications plc 1.50% 23/06/2027	1.086.900	0,50
USD	2.302.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	2.435.385	1,12	GBP	497.550	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	752.690	0,35
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	564.235	0,26	GBP	1.185.000	Bunzl Finance plc 2.25% 11/06/2025	1.504.293	0,69
					GBP	1.568.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	2.191.670	1,01
					EUR	1.056.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	1.175.617	0,54

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
REINO UNIDO (continuación)					REINO UNIDO (continuación)				
GBP	873.000	Cadent Finance plc 2.13% 22/09/2028	1.104.811	0,51	GBP	422.000	Scottish Hydro Electric Transmission plc 2.25% 27/09/2035	523.752	0,24
EUR	2.624.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	2.826.509	1,31					
EUR	464.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	522.510	0,24	GBP	600.000	Severn Trent Water 3.63% 16/01/2026	833.232	0,38
GBP	385.000	Eversholt Funding plc 3.53% 07/08/2042	510.251	0,24	GBP	475.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	607.900	0,28
GBP	840.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	1.173.482	0,54	GBP	129.398	Telereal Securitisation plc 4.97% 10/09/2027	183.435	0,08
EUR	621.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	707.287	0,33	GBP	881.751	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	1.594.475	0,74
GBP	708.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	889.561	0,41	GBP	703.304	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.130.305	0,52
GBP	425.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	569.072	0,26	GBP	510.593	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	813.443	0,38
EUR	37.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	46.071	0,02	GBP	729.000	Tsb Banking Group plc FRN 06/05/2026	911.663	0,42
EUR	424.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	527.949	0,24					
GBP	533.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	855.086	0,39	GBP	610.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	806.322	0,37
USD	850.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	850.386	0,39			Total del Reino Unido	36.073.471	16,62
GBP	453.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	675.523	0,31	ESTADOS UNIDOS				
GBP	400.000	Legal & General Group plc FRN 27/06/2064	577.231	0,27	USD	879.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	973.772	0,45
GBP	250.000	Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	342.821	0,16	USD	640.000	American International Group Inc. 3.90% 01/04/2026	682.894	0,32
GBP	750.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc 1.75% 11/07/2024	929.999	0,43	USD	2.000.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.319.545	1,07
GBP	262.000	Lloyds Bank plc 6.50% 17/09/2040	552.405	0,25	USD	939.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	1.191.105	0,55
GBP	400.000	Nationwide Building Society Perp FRN	504.597	0,23	USD	328.000	Appalachian Power Company 4.40% 15/05/2044	381.723	0,18
EUR	927.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	1.005.468	0,46	USD	1.400.000	AT&T Inc. 4.85% 01/03/2039	1.590.750	0,73
GBP	1.009.000	Northumbrian Water Finance plc 1.63% 11/10/2026	1.252.183	0,58	USD	1.393.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	1.585.097	0,73
GBP	805.000	Pennon Group plc Perp FRN	999.252	0,46	USD	3.614.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	3.657.070	1,69
GBP	255.000	Pension Insurance Corp plc 5.63% 20/09/2030	326.569	0,15	USD	890.000	Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	962.212	0,44
EUR	1.149.000	Royal Bank of Scotland FRN 02/03/2026	1.309.638	0,60	EUR	802.000	Becton Dickinson and Company 1.90% 15/12/2026	939.788	0,43
USD	1.150.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 08/05/2030	1.233.313	0,57	GBP	1.398.000	Becton Dickinson and Company 3.02% 24/05/2025	1.839.439	0,85
USD	1.100.000	Santander UK plc 2.88% 18/06/2024	1.118.081	0,52	USD	880.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	1.045.122	0,47
GBP	275.000	Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	547.719	0,25	USD	1.900.000	BP Capital Markets America Inc. 4.23% 06/11/2028	2.152.879	0,99
					USD	439.000	Broadcom Cayman Finance 3.00% 15/01/2022	443.437	0,20

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD	% del valor liquidativo			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	1.220.000	Cardinal Health Inc. 4.37% 15/06/2047	1.174.256	0,55	USD	808.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	959.550	0,44
USD	560.000	Charter Communications Operating LLC FRN 01/02/2024	572.771	0,26	USD	350.000	Nevada Power Company 6.65% 01/04/2036	497.700	0,23
USD	538.000	Cigna Corp 4.90% 15/12/2048	617.492	0,28	USD	1.687.000	NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	1.977.722	0,91
USD	865.000	Comcast Corp. 4.60% 15/10/2038	1.038.069	0,48	USD	1.280.000	NSTAR Electric Company 3.25% 15/05/2029	1.364.842	0,63
USD	250.000	Conagra Brands Inc. 5.40% 01/11/2048	297.583	0,14	USD	1.367.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	1.463.534	0,68
USD	1.045.000	CSX Corp 4.25% 15/03/2029	1.181.576	0,55	USD	183.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	195.923	0,09
USD	150.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	157.574	0,07	USD	1.008.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	984.020	0,45
USD	709.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	808.342	0,37	USD	739.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	865.429	0,40
EUR	2.549.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	3.067.457	1,41	USD	700.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	804.468	0,37
USD	1.176.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	1.359.699	0,63	USD	576.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	627.853	0,29
EUR	917.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	1.071.494	0,49	USD	956.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	1.069.359	0,49
EUR	170.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	206.372	0,10	EUR	782.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	857.115	0,40
EUR	1.268.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	1.539.292	0,72	USD	1.520.000	United Technologies Corp 4.13% 16/11/2028	1.722.719	0,80
EUR	454.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	611.089	0,28	USD	1.342.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	1.532.480	0,71
EUR	443.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	503.071	0,23	USD	659.000	Virginia Electric & Power Company 4.60% 01/12/2048	809.531	0,37
EUR	1.130.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	1.327.432	0,61	USD	440.000	Voya Financial Inc. 3.13% 15/07/2024	454.379	0,21
USD	572.000	Ford Motor Company 5.29% 08/12/2046	530.503	0,24	USD	1.468.000	Williams Cos Inc. 4.30% 04/03/2024	1.561.022	0,72
EUR	302.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	339.790	0,16	USD	626.000	Williams Cos Inc. 4.85% 01/03/2048	673.228	0,31
GBP	1.356.000	Goldman Sachs Group Inc. 3.13% 25/07/2029	1.821.783	0,84	Total de Estados Unidos		63.544.247	29,29	
USD	500.000	Indiana Michigan Power Company 3.75% 01/07/2047	544.333	0,25	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				
USD	81.000	Indiana Michigan Power Company 6.05% 15/03/2037	109.704	0,05	EUR	800.000	Global Switch Holdings Limited 1.50% 31/01/2024	908.882	0,42
EUR	360.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	403.221	0,19	USD	1.356.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	1.348.179	0,62
USD	948.000	Johnson & Johnson 3.40% 15/01/2038	1.027.488	0,47	Total de Islas Vírgenes (Británicas)		2.257.061	1,04	
USD	1.250.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	1.374.325	0,63	Total de bonos		170.714.427	78,78	
USD	1.209.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.318.808	0,61					
USD	470.000	Kinder Morgan Inc. 4.30% 01/03/2028	510.445	0,24					
USD	1.500.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	1.424.172	0,65					
USD	395.000	Kroger Company 4.65% 15/01/2048	420.399	0,19					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD		% del valor liquidativo			Valor de mercado USD		% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					Bonos (continuación)				
CANADÁ					BERMUDAS				
CAD	1.530.000	Canada (Govt of) 2.25% 01/06/2025	1.210.295	0,56	USD	2.406.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	2.572.035	1,19
Total de Canadá			1.210.295	0,56	Total de Bermudas			2.572.035	1,19
ALEMANIA					DINAMARCA				
EUR	519.000	Germany (Govt of) 2.50% 15/08/2046	973.409	0,45	USD	1.000.000	Danske Bank A/S 2.70% 02/03/2022	1.005.363	0,46
Total de Alemania			973.409	0,45	Total de Dinamarca			1.005.363	0,46
REINO UNIDO					FRANCIA				
GBP	347.000	United Kingdom Gilt 1.50% 22/07/2047	481.684	0,22	USD	1.600.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.592.634	0,74
Total del Reino Unido			481.684	0,22	USD	630.000	Electricite de France 4.88% 22/01/2044	734.038	0,34
ESTADOS UNIDOS					USD	270.000	Electricite de France 4.88% 21/09/2038	316.410	0,15
USD	9.180.000	United States Treasury N/B 2.75% 15/02/2028	9.969.623	4,60	Total de Francia			2.643.082	1,23
USD	5.539.000	United States Treasury N/B 2.75% 15/08/2047	6.275.514	2,90	ITALIA				
USD	1.500.000	United States Treasury N/B 2.88% 15/08/2028	1.650.000	0,76	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	299.962	0,14
Total de Estados Unidos			17.895.137	8,26	Total de Italia			299.962	0,14
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					PAÍSES BAJOS				
			20.560.525	9,49	USD	254.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	351.587	0,16
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					USD	409.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	440.941	0,20
			191.274.952	88,27	Total de Países Bajos			792.528	0,36
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					ESTADOS UNIDOS				
Bonos					USD	350.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	402.662	0,19
AUSTRALIA					USD	212.000	Erac USA Finance LLC P.P. 144A 4.50% 15/02/2045	236.235	0,11
USD	1.362.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	1.461.944	0,67	USD	917.000	Five Corners Funding P.P. 144A 4.42% 15/11/2023	991.161	0,45
USD	1.500.000	Sydney Airport Finance Company Pty Limited 3.63% 28/04/2026	1.566.643	0,72	USD	573.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	732.524	0,34
USD	1.765.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.920.361	0,89	USD	417.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	468.113	0,22
Total de Australia			4.948.948	2,28	USD	400.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	468.675	0,22

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)			
Bonos (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
USD	402.000 Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	430.769	0,20
USD	495.000 Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	521.220	0,24
USD	572.000 Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	653.996	0,30
Total de Estados Unidos		4.905.355	2,27
Total de bonos		17.167.273	7,93
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		17.167.273	7,93
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
PORTUGAL			
EUR	200.000 Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	45.521	0,02
Total de Portugal		45.521	0,02
ESTADOS UNIDOS			
USD	1.950.000 Oncor Electric Delivery Company LLC 3.70% 15/11/2028	2.152.045	1,00
Total de Estados Unidos		2.152.045	1,00
Total de bonos		2.197.566	1,02
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		2.197.566	1,02
Valor total de las inversiones		210.639.791	97,22
(Coste total: USD 202.576.255)			

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
AUSTRALIA					FRANCIA (continuación)				
EUR	1.269.000	APT Pipelines Limited 2.00% 22/03/2027	1.389.295	1,03	EUR	1.600.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	1.706.873	1,27
EUR	700.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	812.520	0,60	USD	462.000	Credit Agricole SA Perp FRN	457.861	0,34
EUR	1.588.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	1.667.322	1,24	EUR	1.000.000	Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	1.062.416	0,79
EUR	1.172.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.227.765	0,91	EUR	200.000	Electricite de France SA 1.88% 13/10/2036	222.785	0,17
	Total de Australia		5.096.902	3,78	EUR	800.000	Electricite de France SA 2.00% 02/10/2030	909.363	0,67
BÉLGICA					EUR	600.000	HSBC France SA 1.38% 04/09/2028	660.608	0,49
EUR	517.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.13% 01/07/2027	548.653	0,41	EUR	1.600.000	Orange SA 0.00% 04/09/2026	1.578.557	1,17
EUR	1.106.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.75% 17/03/2036	1.397.065	1,04	EUR	900.000	Pernod Ricard SA 2.00% 22/06/2020	914.764	0,68
EUR	500.000	Argenta Spaarbank NV 1.00% 06/02/2024	518.999	0,39	EUR	480.000	RCI Banque SA 2.00% 11/07/2024	513.538	0,38
EUR	800.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	789.992	0,59	EUR	200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.13% 09/09/2049	197.464	0,15
EUR	400.000	Belfius Bank SA Perp FRN	363.516	0,27	EUR	1.100.000	Sanofi 0.00% 21/03/2022	1.105.434	0,82
EUR	400.000	KBC Group NV Perp FRN	427.944	0,32	EUR	2.100.000	Total Capital International SA FRN 19/03/2020	2.103.595	1,56
	Total de Bélgica		4.046.169	3,02		Total de Francia		15.095.605	11,21
BERMUDAS					ALEMANIA				
USD	800.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	842.036	0,62	EUR	900.000	ADLER Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	915.939	0,68
	Total de Bermudas		842.036	0,62	EUR	500.000	ADLER Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	530.571	0,39
DINAMARCA					EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	693.301	0,51
EUR	1.000.000	Danske Bank A/S 0.75% 02/06/2023	1.025.575	0,76	EUR	987.000	Basf SE FRN 15/11/2019	987.520	0,73
	Total de Dinamarca		1.025.575	0,76	EUR	1.516.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	1.572.622	1,17
FINLANDIA					EUR	1.269.000	Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	1.309.500	0,97
EUR	270.000	Sampo Oyj FRN 23/05/2049	305.338	0,23	EUR	1.100.000	Eurogrid GmbH 1.88% 10/06/2025	1.206.508	0,90
	Total de Finlandia		305.338	0,23	EUR	1.200.000	FMS Wertmanagement 0.13% 16/04/2020	1.203.792	0,89
FRANCIA					EUR	633.000	Innogy Finance BV 5.75% 14/02/2033	1.032.316	0,77
EUR	900.000	Autoroutes du Sud de la France SA 4.13% 13/04/2020	920.913	0,69	EUR	1.012.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.63% 20/01/2020	1.024.984	0,76
EUR	316.000	Axa SA FRN 28/05/2049	358.474	0,27	EUR	800.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	785.043	0,58
EUR	400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 17/07/2025	415.038	0,31	EUR	700.000	Vier Gas Transport GmbH 1.50% 25/09/2028	779.428	0,58
EUR	1.900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	1.967.922	1,45		Total de Alemania		12.041.524	8,93

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
IRLANDA					LUXEMBURGO (continuación)				
EUR	860.000	AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	924.436	0,69	EUR	204.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 02/07/2031	212.633	0,16
EUR	367.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	394.337	0,29	EUR	1.106.000	Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	1.148.290	0,85
EUR	767.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	862.893	0,64			Total de Luxemburgo	7.187.368	5,34
Total de Irlanda			2.181.666	1,62	PAÍSES BAJOS				
ITALIA					EUR	691.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	707.521	0,52
EUR	383.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	449.966	0,33	EUR	900.000	Bayer Capital Corp BV 1.50% 26/06/2026	956.760	0,71
EUR	420.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	407.955	0,30	EUR	400.000	Bayer Capital Corp. BV 2.13% 15/12/2029	441.488	0,33
EUR	571.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	571.645	0,42	EUR	1.197.000	BMW Finance NV 0.13% 13/07/2022	1.201.429	0,90
EUR	459.000	FCA Bank SpA 0.63% 24/11/2022	464.005	0,34	EUR	3.500.000	Deutsche Telekom International Finance BV FRN 03/04/2020	3.505.622	2,60
Total de Italia			1.893.571	1,39	EUR	935.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	970.285	0,72
JAPÓN					EUR	700.000	Enexis Holding NV 0.88% 28/04/2026	741.463	0,55
EUR	766.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.55% 06/11/2023	791.262	0,59	EUR	500.000	Koninklijke KPN NV 3.25% 01/02/2021	523.118	0,39
Total de Japón			791.262	0,59	EUR	575.000	Rabobank 1.38% 03/02/2027	632.110	0,47
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					EUR	961.000	Stedin Holding NV 1.38% 19/09/2028	1.046.675	0,78
EUR	912.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	989.918	0,73	EUR	984.000	Stedin Holding NV Perp FRN	1.041.326	0,77
Total de Jersey - Islas del Canal			989.918	0,73	EUR	600.000	Syngenta Finance NV 1.25% 10/09/2027	588.707	0,44
LUXEMBURGO					EUR	700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	724.572	0,54
EUR	1.255.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	1.296.874	0,96	EUR	700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	771.849	0,57
EUR	1.395.000	Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	1.459.308	1,09	EUR	298.000	TenneT Holding BV 0.88% 03/06/2030	313.371	0,23
EUR	540.000	CPI Property Group SA 2.13% 04/10/2024	571.877	0,42	EUR	553.000	TenneT Holding BV 2.13% 01/11/2020	566.665	0,42
EUR	640.000	DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	642.309	0,48	EUR	900.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.178.793	0,87
EUR	354.000	DH Europe Finance II Sarl 0.75% 18/09/2031	355.990	0,26			Total de Países Bajos	15.911.754	11,81
EUR	300.000	Glencore Finance Europe Limited 3.75% 01/04/2026	349.102	0,26	NORUEGA				
EUR	800.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	834.241	0,62	EUR	1.541.000	DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	1.557.614	1,16
EUR	300.000	Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	316.744	0,24	EUR	1.074.000	DNB Boligkreditt AS 0.38% 20/10/2020	1.083.228	0,80
							Total de Noruega	2.640.842	1,96

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ESPAÑA					REINO UNIDO (continuación)				
EUR	400.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 18/01/2029	431.701	0,32	GBP	850.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	1.089.205	0,82
EUR	400.000	Abertis Infraestructuras SA 3.00% 27/03/2031	453.068	0,34	EUR	1.125.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	1.160.034	0,86
EUR	500.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	536.693	0,40	GBP	709.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	870.800	0,64
EUR	800.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	833.823	0,62	EUR	735.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	839.474	0,62
EUR	700.000	Caixabank SA FRN 17/04/2030	721.070	0,53	EUR	838.000	Imperial Brands Finance plc 1.13% 14/08/2023	856.678	0,64
EUR	1.154.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.253.407	0,93	EUR	778.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	879.038	0,65
	Total de España		4.229.762	3,14	EUR	393.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc 0.25% 04/10/2022	393.466	0,29
SUECIA					EUR	1.162.000	Motability Operations Group plc 0.38% 03/01/2026	1.166.648	0,87
EUR	2.050.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	2.161.750	1,60	EUR	649.000	National Express Group plc FRN 15/05/2020	648.619	0,48
EUR	420.000	Essity AB 0.50% 26/05/2021	424.446	0,31	EUR	570.000	NatWest Markets plc FRN 27/09/2021	574.455	0,43
EUR	615.000	Nordea Bank AB 0.30% 30/06/2022	623.026	0,46	EUR	789.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	784.981	0,58
EUR	1.026.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	1.076.265	0,81	GBP	887.000	Pennon Group plc Perp FRN	1.009.942	0,74
	Total de Suecia		4.285.487	3,18	EUR	545.000	Rolls-Royce plc 1.63% 09/05/2028	586.313	0,44
REINO UNIDO					EUR	1.857.000	Royal Bank of Scotland FRN 02/03/2026	1.941.499	1,44
EUR	355.000	Aviva plc FRN 03/07/2044	389.768	0,29	EUR	1.289.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	1.396.746	1,03
EUR	380.000	Barclays plc FRN 07/02/2028	377.286	0,28		Total del Reino Unido		26.814.708	19,89
EUR	820.000	Bat International Finance plc 2.75% 25/03/2025	903.133	0,67	ESTADOS UNIDOS				
EUR	1.133.000	BP Capital Markets plc 0.83% 08/11/2027	1.176.312	0,87	EUR	653.000	American International Group Inc. 1.88% 21/06/2027	712.915	0,53
EUR	830.000	British Telecommunications plc 1.50% 23/06/2027	871.040	0,65	EUR	810.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	986.284	0,73
EUR	1.978.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	2.019.863	1,50	EUR	1.270.000	BAT Capital Corp. 1.13% 16/11/2023	1.300.641	0,96
GBP	1.085.962	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	1.433.442	1,06	EUR	863.000	Becton Dickinson and Company 1.90% 15/12/2026	927.598	0,69
EUR	415.000	Diageo Finance plc 0.00% 17/11/2020	416.093	0,31	EUR	885.000	Berkshire Hathaway Inc. 1.13% 16/03/2027	941.143	0,69
EUR	735.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	771.297	0,57	EUR	957.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	1.056.366	0,79
EUR	1.779.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	1.757.747	1,31	EUR	750.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	827.873	0,61
EUR	423.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	436.929	0,32	EUR	484.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	502.708	0,37
EUR	500.000	ELM BV for RELX Finance BV 2.50% 24/09/2020	513.431	0,38	EUR	245.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	255.771	0,19
EUR	698.000	Experian Finance plc 1.38% 25/06/2026	743.485	0,55					
EUR	360.000	Experian Finance plc 4.75% 04/02/2020	366.164	0,27					
EUR	440.000	FCE Bank plc 1.62% 11/05/2023	440.820	0,33					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
ESTADOS UNIDOS (continuación)					ALEMANIA				
EUR	681.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	729.897	0,54	EUR	410.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2029	434.069	0,32
EUR	946.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	1.053.383	0,78	EUR	111.680	Germany (Govt of) 1.25% 15/08/2048	155.969	0,12
EUR	270.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	300.649	0,22	Total de Alemania			590.038	0,44
EUR	160.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	197.543	0,15	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EUR	325.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	338.535	0,25				590.038	0,44
EUR	610.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	657.291	0,49	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
EUR	1.647.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	1.699.772	1,26				125.894.741	93,41
EUR	470.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	482.872	0,36	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
EUR	351.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/07/2031	364.194	0,27	Bonos				
EUR	419.000	JPMorgan Chase & Company FRN 12/06/2029	466.582	0,35	BERMUDAS				
EUR	1.155.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	1.231.664	0,91	USD	840.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	823.672	0,61
EUR	660.000	Metropolitan Life Global Funding I 0.38% 09/04/2024	669.781	0,50	Total de Bermudas			823.672	0,61
EUR	1.205.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	1.251.732	0,93	FRANCIA				
EUR	535.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	537.873	0,40	USD	1.100.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.004.344	0,75
EUR	798.000	Verizon Communications Inc. 0.88% 08/04/2027	824.255	0,61	Total de Francia			1.004.344	0,75
EUR	424.000	Verizon Communications Inc. 2.88% 15/01/2038	526.857	0,39	ITALIA				
Total de Estados Unidos			18.844.179	13,97	USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	458.574	0,34
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					Total de Italia			458.574	0,34
EUR	671.000	Global Switch Holdings Limited 1.50% 31/01/2024	699.253	0,52	PAÍSES BAJOS				
EUR	350.000	Global Switch Holdings Limited 2.25% 31/05/2027	381.784	0,28	USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.137.231	0,84
Total de las Islas Vírgenes (Británicas)			1.081.037	0,80	Total de Países Bajos			1.137.231	0,84
Total de bonos			125.304.703	92,97	Total de bonos			3.423.821	2,54
					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
								3.423.821	2,54

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
PORTUGAL			
EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	125.265 0,09
	Total de Portugal	125.265	0,09
REINO UNIDO			
GBP	300.000	Cattles Limited 7.13% 05/07/2047	1.558 0,00
EUR	350.000	Lehman Brothers UK Capital Funding III LP 3.88% 22/02/2167*	0 0,00
	Total del Reino Unido	1.558	0,00
	Total de bonos	126.823	0,09
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	126.823	0,09
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
	48.999	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	4.887.389 3,63
	Total de Irlanda	4.887.389	3,63
	Total de fondos	4.887.389	3,63
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	4.887.389	3,63
	Valor total de las inversiones	134.332.774	99,67

(Coste total: EUR 128.461.335)

*Valor razonable.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
BÉLGICA					FRANCIA (continuación)				
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA Perp FRN	3.290.649	0,68	EUR	480.000	CMA CGM SA 5.25% 15/01/2025	343.650	0,07
EUR	1.449.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	1.486.960	0,31	EUR	931.000	Credit Agricole SA Perp FRN	1.007.769	0,21
EUR	200.000	Solvay SA Perp FRN	220.980	0,05	EUR	2.601.000	Crown European Holdings 2.63% 30/09/2024	2.808.480	0,58
	Total de Bélgica		4.998.589	1,04	EUR	750.000	Crown European Holdings 3.38% 15/05/2025	833.924	0,17
CANADÁ					EUR	1.403.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	1.526.406	0,31
EUR	1.570.000	Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15/05/2023	1.590.410	0,33	EUR	1.500.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	1.500.256	0,31
EUR	2.524.000	Cott Corp. 5.50% 01/07/2024	2.635.672	0,54	EUR	500.000	Elis SA 1.63% 03/04/2028	500.543	0,10
	Total de Canadá		4.226.082	0,87	EUR	2.500.000	Elis SA 1.75% 11/04/2024	2.595.199	0,53
ISLAS CAIMÁN					EUR	1.900.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	2.087.277	0,43
GBP	878.000	Petrobras International Finance Company 6.25% 14/12/2026	1.177.083	0,24	EUR	677.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	719.737	0,15
EUR	135.000	UPCB Finance IV Limited 4.00% 15/01/2027	142.893	0,03	EUR	232.000	Getlink SE 3.63% 01/10/2023	242.552	0,05
EUR	1.421.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029	1.511.370	0,31	EUR	1.362.000	La Financiere Atalian 4.00% 15/05/2024	1.006.133	0,21
	Total de las Islas Caimán		2.831.346	0,58	EUR	632.000	La Financiere Atalian 5.13% 15/05/2025	465.052	0,10
FINLANDIA					EUR	1.118.000	Louvre Bidco SAS FRN 30/09/2024	1.136.307	0,23
EUR	932.000	Nokia Oyj 2.00% 11/03/2026	982.305	0,20	EUR	2.324.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	2.397.797	0,49
	Total de Finlandia		982.305	0,20	EUR	1.155.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	1.199.226	0,25
FRANCIA					EUR	900.000	Orange SA Perp FRN	944.409	0,19
EUR	934.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	949.566	0,19	EUR	183.000	Orange SA Perp FRN	197.087	0,04
EUR	1.660.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	1.689.852	0,35	EUR	1.121.000	Orange SA Perp FRN	1.368.332	0,28
EUR	987.000	Altice France SA 5.63% 15/05/2024	1.018.831	0,21	GBP	425.000	Orange SA Perp FRN	523.932	0,11
EUR	5.072.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	5.627.536	1,16	EUR	500.000	Orano SA 3.13% 20/03/2023	539.420	0,11
EUR	1.900.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	1.760.431	0,36	EUR	600.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	646.996	0,13
EUR	1.800.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.05% 05/08/2026	1.580.875	0,33	EUR	1.400.000	Orano SA 3.50% 22/03/2021	1.463.666	0,31
EUR	800.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	765.225	0,16	EUR	150.000	Orano SA 4.88% 23/09/2024	174.920	0,04
EUR	1.500.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	1.434.796	0,29	EUR	2.322.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	2.185.286	0,45
EUR	800.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.98% 26/05/2021	823.895	0,17	EUR	404.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2025	413.561	0,08
EUR	1.100.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	1.029.515	0,21	EUR	125.000	Rexel SA 2.63% 15/06/2024	127.992	0,03
					EUR	1.134.000	Rexel SA 2.75% 15/06/2026	1.186.915	0,24
					EUR	986.000	Solvay Finance SA Perp FRN	1.063.070	0,22
					EUR	2.880.000	Solvay Finance SA Perp FRN	3.410.856	0,69
					EUR	2.033.000	SPCM SA 2.88% 15/06/2023	2.056.446	0,42
					EUR	2.600.000	SPIE SA 2.63% 18/06/2026	2.710.953	0,56
						Total de Francia		56.064.671	11,52
ALEMANIA					EUR	1.503.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	1.528.698	0,31
					EUR	1.920.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	1.974.000	0,41
					EUR	2.600.000	ADLER Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	2.646.046	0,54

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ALEMANIA (continuación)				IRLANDA (continuación)					
EUR	800.000	ADLER Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	848.914	0,17	EUR	2.597.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.88% 15/01/2026	2.862.584	0,59
EUR	376.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 2.88% 15/07/2022	381.771	0,08	EUR	2.267.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.50% 15/09/2027	2.273.660	0,47
EUR	993.000	Douglas GmbH 6.25% 15/07/2022	996.818	0,20	GBP	1.293.000	Virgin Media Receivables Financing Note 5.50% 15/09/2024	1.499.811	0,31
EUR	815.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	846.196	0,17	GBP	100.000	Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC 5.75% 15/04/2023	116.194	0,02
EUR	748.360	IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/09/2026	771.529	0,16	Total de Irlanda		21.423.222	4,39	
EUR	531.000	Kirk Beauty One GmbH 8.75% 15/07/2023	422.448	0,09					
EUR	1.623.000	Lanxess AG FRN 06/12/2076	1.784.273	0,37	ISLA DE MAN				
EUR	1.201.000	Platin 1426 GmbH 5.38% 15/06/2023	1.131.685	0,23	EUR	1.741.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.820.388	0,37
EUR	1.350.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	1.361.001	0,28	EUR	704.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	757.393	0,16
EUR	1.872.000	Safari Verwaltungs GmbH 5.38% 30/11/2022	1.210.922	0,25	Total de la Isla de Man		2.577.781	0,53	
EUR	2.510.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	2.382.492	0,49	ITALIA				
EUR	2.189.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	2.374.466	0,49	EUR	1.022.000	Enel SpA FRN 24/05/2080	1.107.082	0,23
EUR	606.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	581.617	0,12	EUR	201.000	Enel SpA FRN 10/01/2074	233.708	0,05
EUR	1.689.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	1.690.770	0,35	GBP	1.303.000	Enel SpA FRN 15/09/2076	1.610.881	0,33
EUR	2.137.000	Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	2.190.700	0,45	EUR	2.327.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	2.395.879	0,49
EUR	2.185.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	2.254.757	0,46	EUR	378.000	Leonardo SpA 1.50% 07/06/2024	392.556	0,08
EUR	325.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH 3.75% 15/05/2024	331.796	0,07	EUR	241.000	Leonardo SpA 4.88% 24/03/2025	291.607	0,06
Total de Alemania		27.710.899	5,69		EUR	1.307.000	Lkq Italia Bondco SpA 3.88% 01/04/2024	1.481.535	0,30
					EUR	3.491.000	Nexi Capital SpA 4.13% 01/11/2023	3.595.625	0,73
					EUR	1.852.000	Rossini Srl 6.75% 30/10/2025	2.048.643	0,42
					EUR	1.322.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	1.392.231	0,29
					EUR	2.593.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	2.712.916	0,56
					EUR	275.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	289.800	0,06
					EUR	375.000	Telecom Italia SpA 3.25% 16/01/2023	406.132	0,08
IRLANDA					EUR	2.133.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	2.355.580	0,48
EUR	4.107.000	Ardagh Packaging Finance 2.75% 15/03/2024	4.202.240	0,86	EUR	2.358.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	2.603.776	0,53
EUR	2.187.000	Ardagh Packaging Finance 6.75% 15/05/2024	2.304.568	0,47	EUR	2.974.000	Telecom Italia SpA 4.50% 25/01/2021	3.149.147	0,65
EUR	1.704.000	Bank of Ireland Perp FRN	1.772.783	0,36	EUR	650.000	Telecom Italia SpA 5.25% 10/02/2022	728.319	0,15
EUR	354.000	Bank of Ireland 10.00% 19/12/2022	453.513	0,09	EUR	900.000	Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2055	1.030.054	0,21
EUR	3.738.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	3.997.731	0,82	Total de Italia		27.825.471	5,70	
EUR	1.828.000	James Hardie International Finance DAC 3.63% 01/10/2026	1.940.138	0,40					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
JAPÓN					LUXEMBURGO (continuación)				
EUR	1.302.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	1.397.959	0,29	EUR	1.649.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 15/07/2022	1.851.740	0,38
EUR	5.574.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	6.214.870	1,29	EUR	1.564.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	1.494.558	0,31
Total de Japón			7.612.829	1,58	GBP	1.659.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.50% 01/11/2022	1.769.822	0,36
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					EUR	1.205.000	Gestamp Fund Lux 3.50% 15/05/2023	1.227.317	0,25
EUR	2.506.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	2.682.533	0,55	EUR	2.900.000	Grand City Properties SA Perp FRN	3.101.236	0,64
EUR	3.841.008	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	4.008.241	0,82	EUR	857.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	828.849	0,17
Total de Jersey - Islas del Canal			6.690.774	1,37	EUR	3.204.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	3.597.039	0,73
LUXEMBURGO					EUR	1.711.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	1.801.050	0,37
USD	607.000	Altice Financing SA 6.63% 15/02/2023	572.194	0,12	EUR	3.092.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	3.168.475	0,65
USD	1.926.000	Altice Finco SA 8.13% 15/01/2024	1.827.535	0,38	EUR	650.000	Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	667.378	0,14
EUR	694.000	Altice Finco SA 9.00% 15/06/2023	722.122	0,15	EUR	1.502.000	Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	725.804	0,15
EUR	1.284.000	Altice Luxembourg SA 6.25% 15/02/2025	1.344.210	0,28	EUR	1.125.000	Leonardo SpA 4.50% 19/01/2021	1.188.467	0,24
EUR	1.035.831	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/05/2022	1.058.316	0,22	EUR	1.204.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.246.459	0,26
EUR	4.995.000	Altice Luxembourg SA 8.00% 15/05/2027	5.500.108	1,14	EUR	470.000	LSF10 Wolverine Investments SCA FRN 15/03/2024	473.413	0,10
EUR	1.243.000	Aramark International Finance 3.13% 01/04/2025	1.285.038	0,26	EUR	1.148.000	LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 15/03/2024	1.182.253	0,24
EUR	920.000	ARD Finance SA 6.63% 15/09/2023	953.346	0,20	EUR	1.610.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	1.645.937	0,34
EUR	100.000	Arena Luxembourg Finance Sarl FRN 01/11/2023	101.051	0,02	EUR	530.000	Picard Bondco SA 5.50% 30/11/2024	516.610	0,11
EUR	904.000	Arena Luxembourg Finance Sarl 2.88% 01/11/2024	943.752	0,19	EUR	1.318.000	Swissport Financing Sarl 5.25% 15/08/2024	1.369.372	0,27
EUR	550.000	BMBG Bond Finance SCA 3.00% 15/06/2021	553.755	0,11	EUR	649.000	Swissport Financing Sarl 9.00% 15/02/2025	672.446	0,14
EUR	607.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	640.859	0,13	EUR	536.000	Takko Luxembourg 2 SCA 5.38% 15/11/2023	511.514	0,11
EUR	1.339.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	1.426.769	0,29	EUR	1.218.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	1.815.062	0,37
EUR	738.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	730.858	0,15	EUR	1.500.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	1.618.112	0,33
EUR	940.000	CPI Property Group SA Perp FRN	964.023	0,20	EUR	1.628.900	Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.88% 15/07/2027	1.806.806	0,37
EUR	1.003.000	CPI Property Group SA Perp FRN	1.050.081	0,22	Total de Luxemburgo			56.369.698	11,59
EUR	2.335.000	Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	2.415.962	0,50					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
MÉXICO					PAÍSES BAJOS (continuación)				
EUR	1.000.000	Cemex SAB de CV 2.75% 05/12/2024	1.030.998	0,21	EUR	1.052.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	980.567	0,20
USD	726.000	Cemex SAB de CV 7.75% 16/04/2026	724.618	0,15	EUR	300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	255.935	0,05
		Total de México	1.755.616	0,36	EUR	855.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	906.361	0,19
PAÍSES BAJOS					EUR	1.376.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	1.439.943	0,30
EUR	905.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	937.006	0,19	EUR	1.098.000	UPC Holding BV 3.88% 15/06/2029	1.157.469	0,24
EUR	2.298.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.445.144	0,51	EUR	1.589.000	Ziggo Bond Finance BV FRN 15/01/2025	1.638.975	0,33
EUR	1.176.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	1.211.830	0,25	EUR	447.000	Ziggo BV 3.75% 15/01/2025	458.928	0,09
EUR	1.550.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/03/2024	1.745.958	0,36	EUR	1.604.000	Ziggo BV 4.25% 15/01/2027	1.735.152	0,36
GBP	2.547.000	Intergen NV 7.50% 30/06/2021	2.856.116	0,58			Total de Países Bajos	61.936.242	12,71
EUR	2.850.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	3.007.901	0,62					
EUR	4.168.000	InterXion Holding NV 4.75% 15/06/2025	4.527.513	0,93	ESPAÑA				
GBP	1.448.000	Koninklijke KPN NV FRN 14/03/2023	1.674.650	0,34	EUR	2.500.000	Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	2.682.386	0,55
EUR	2.579.000	LKQ Euro Holdings BV 3.63% 01/04/2026	2.708.824	0,55	EUR	800.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	883.783	0,18
EUR	189.000	OI European Group BV 4.88% 31/03/2021	202.071	0,04	EUR	1.000.000	Distribuidora Internacional de Alimentacion 1.00% 28/04/2021	780.625	0,16
EUR	2.222.000	Petrobras Global Finance BV 4.75% 14/01/2025	2.609.562	0,54	EUR	2.611.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	2.690.058	0,55
GBP	739.000	Petrobras Global Finance BV 6.63% 16/01/2034	995.561	0,20	EUR	1.445.000	Tasty Bondco 1 SA 6.25% 15/05/2026	1.525.844	0,31
EUR	100.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	104.995	0,02			Total de España	8.562.696	1,75
EUR	1.436.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2025	1.656.086	0,34	SUPRANACIONAL				
EUR	1.101.635	Summer BidCo BV 9.00% 17/11/2025	1.162.509	0,24	EUR	705.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	724.892	0,15
EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	310.531	0,06			Total de supranacional	724.892	0,15
EUR	2.600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	2.866.868	0,59	SUECIA				
EUR	3.900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	4.134.600	0,85	EUR	3.356.000	Akelius Residential AB FRN 05/10/2078	3.606.865	0,74
EUR	4.900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	5.270.767	1,08	EUR	2.276.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	2.319.841	0,48
EUR	1.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.973.714	0,41	EUR	505.000	Volvo Car AB 2.00% 24/01/2025	524.855	0,11
GBP	2.000.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	2.392.738	0,49	EUR	1.571.000	Volvo Car AB 2.13% 02/04/2024	1.639.919	0,34
EUR	3.285.000	TenneT Holding BV Perp FRN	3.516.801	0,72			Total de Suecia	8.091.480	1,67
EUR	3.966.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.13% 15/10/2024	2.987.773	0,62					
EUR	2.455.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	2.063.394	0,42					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
SUIZA					REINO UNIDO (continuación)				
USD	2.370.000	Credit Suisse AG 6.50% 08/08/2023	2.425.761	0,50	EUR	220.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	187.976	0,04
USD	859.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	873.573	0,18	GBP	1.022.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	1.090.918	0,22
EUR	2.038.000	UBS Group AG Perp FRN	2.237.045	0,46	GBP	465.000	Lloyds TSB Bank plc FRN 29/01/2049	929.278	0,19
		Total de Suiza	5.536.379	1,14	EUR	2.450.000	Merlin Entertainments plc 2.75% 15/03/2022	2.606.698	0,54
REINO UNIDO					GBP	100.000	Miller Homes 5.50% 15/10/2024	115.688	0,02
EUR	1.287.000	Algeco Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	1.298.422	0,27	USD	641.000	Neptune Energy Bondco plc 6.63% 15/05/2025	604.546	0,12
GBP	2.116.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	2.303.772	0,47	EUR	370.000	OTE plc 0.88% 24/09/2026	369.877	0,08
GBP	1.757.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	2.125.328	0,44	EUR	1.521.000	OTE plc 3.50% 09/07/2020	1.560.634	0,32
GBP	3.398.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	3.833.015	0,79	GBP	1.704.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	2.055.598	0,42
EUR	628.000	Boparan Finance 4.38% 15/07/2021	392.500	0,08	USD	1.339.000	Royal Bank of Scotland 8.63% Perp	1.316.769	0,27
GBP	510.000	Boparan Finance plc 5.50% 15/07/2021	358.811	0,07	GBP	1.633.000	Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	2.983.355	0,61
GBP	1.466.000	Co-operative Group FRN 08/07/2026	1.884.576	0,39	GBP	1.621.000	Shop Direct 7.75% 15/11/2022	1.626.450	0,33
GBP	821.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	978.616	0,20	GBP	1.702.000	Stonegate Pub Company Financing plc FRN 15/03/2022	1.947.022	0,40
GBP	464.000	Drax Finco plc 4.25% 01/05/2022	534.028	0,11	EUR	2.076.000	Synlab Unsecured Bondco plc 8.25% 01/07/2023	2.171.630	0,45
EUR	843.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	853.691	0,18	GBP	560.000	Tesco Corporate Treasury Services plc 2.50% 02/05/2025	644.791	0,13
GBP	1.120.000	El Group plc 6.88% 15/02/2021	1.305.026	0,27	GBP	231.000	Tesco plc 5.50% 13/01/2033	336.113	0,07
GBP	1.216.000	El Group plc 7.50% 15/03/2024	1.475.395	0,30	GBP	324.000	Tesco plc 6.13% 24/02/2022	407.806	0,08
USD	3.395.670	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	2.573.539	0,53	GBP	2.010.951	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	3.335.544	0,69
GBP	1.040.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	1.198.588	0,25	GBP	672.347	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	991.151	0,20
GBP	500.000	Heathrow Finance plc 3.88% 01/03/2027	566.080	0,12	GBP	507.647	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	741.837	0,15
EUR	100.000	Ineos Finance plc 2.13% 15/11/2025	97.725	0,02	GBP	995.000	Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	1.190.526	0,25
EUR	2.150.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	2.129.560	0,44	EUR	1.693.000	Victoria plc 5.25% 15/07/2024	1.745.786	0,36
EUR	1.511.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.512.877	0,31	EUR	1.615.000	Virgin Media Finance plc 4.50% 15/01/2025	1.669.257	0,34
EUR	816.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	883.086	0,18	GBP	1.483.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.88% 15/01/2027	1.747.471	0,36
EUR	1.297.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.381.776	0,28	GBP	1.190.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	1.419.208	0,29
EUR	870.000	International Game Technology plc 4.75% 15/02/2023	962.651	0,20	GBP	1.847.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.13% 15/01/2025	2.163.066	0,44
GBP	3.623.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	4.123.127	0,85	GBP	1.168.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	1.420.215	0,29
GBP	2.926.000	Jaguar Land Rover 3.88% 01/03/2023	2.917.372	0,60	EUR	2.676.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	2.837.519	0,58
					EUR	910.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.039.897	0,21

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
Bonos (continuación)					Bonos				
REINO UNIDO (continuación)					ESTADOS UNIDOS				
GBP	436.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	524.494	0,11	USD	275.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 5.00% 15/07/2027	262.180	0,05
USD	2.135.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	2.118.033	0,43	USD	691.000	Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	658.140	0,14
USD	1.403.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	1.483.471	0,30	Total de Estados Unidos			920.320	0,19
GBP	605.000	William Hill plc 4.75% 01/05/2026	709.458	0,15	Total de bonos			920.320	0,19
GBP	1.932.000	William Hill plc 4.88% 07/09/2023	2.344.521	0,48	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			920.320	0,19
Total del Reino Unido			84.126.164	17,27					
ESTADOS UNIDOS									
EUR	4.031.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	4.316.951	0,89	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
EUR	604.000	Ball Corp 3.50% 15/12/2020	629.925	0,13	Bonos				
EUR	1.352.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	1.576.235	0,32	PAÍSES BAJOS				
EUR	2.597.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 4.75% 15/12/2024	2.682.576	0,55	EUR	2.866.497	Boats Investments Netherlands BV 11.00% 23/09/2099	967.443	0,20
EUR	1.473.000	Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	1.550.214	0,32	USD	111.070	OSX 3 Leasing BV 0.00% 31/12/2050	0	0,00
EUR	1.386.000	Colfax Corp. 3.25% 15/05/2025	1.428.797	0,29	USD	111.070	OSX 3 Leasing BV 0.00% 31/12/2050	0	0,00
EUR	3.403.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	3.534.538	0,73	USD	3.068.649	OSX 3 Leasing BV 13.00% 20/03/2027	731.837	0,15
EUR	4.532.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	4.731.242	0,96	Total de Países Bajos			1.699.280	0,35
USD	1.064.000	Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	1.052.825	0,22	PORTUGAL				
EUR	2.696.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	2.752.532	0,57	EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049	257.685	0,05
EUR	4.941.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	5.076.322	1,04	EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	1.440.548	0,30
EUR	3.836.000	IQVIA Inc. 3.50% 15/10/2024	3.916.189	0,80	EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2020	378.651	0,08
EUR	647.000	Iron Mountain Inc. 3.00% 15/01/2025	664.575	0,14	Total de Portugal			2.076.884	0,43
EUR	1.658.000	Kronos International 3.75% 15/09/2025	1.661.109	0,34	REINO UNIDO				
EUR	4.379.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	4.657.394	0,95	GBP	1.464.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.690.678	0,35
EUR	2.708.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.878.929	0,59	Total del Reino Unido			1.690.678	0,35
EUR	3.278.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	3.653.375	0,75	Total de bonos			5.466.842	1,13
EUR	2.684.000	Refinitiv US Holdings Inc. 4.50% 15/05/2026	2.897.210	0,59					
EUR	2.057.000	Refinitiv US Holdings Inc. 6.88% 15/11/2026	2.307.879	0,47					
EUR	2.503.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	2.571.664	0,53					
EUR	3.655.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	3.865.276	0,79					
EUR	2.031.000	UGI International LLC 3.25% 01/11/2025	2.154.274	0,44					
Total de Estados Unidos			60.560.031	12,41					
Total de bonos			450.607.167	92,52					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa									
			450.607.167	92,52					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Renta variable			
REINO UNIDO			
434	Nv Profit Share Limited	0	0,00
	Total del Reino Unido	0	0,00
	Total de renta variable	0	0,00
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	5.466.842	1,13
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
4.003.918	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	4.525.801	0,93
113.763	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	11.347.399	2,33
	Total de Irlanda	15.873.200	3,26
	Total de fondos	15.873.200	3,26
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	15.873.200	3,26
	Valor total de las inversiones	472.867.529	97,10
(Coste total: EUR 462.095.676)			

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*

Estado de cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
AUSTRIA					ALEMANIA				
EUR	100.000	Sappi Papier Holding GmbH 4.00% 01/04/2023	102.081	0,27	EUR	100.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	101.710	0,27
		Total de Austria	102.081	0,27	EUR	200.000	Adler Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	201.946	0,53
CANADÁ					EUR	400.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	407.084	1,08
EUR	320.000	Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15/05/2023	324.159	0,86	EUR	220.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 2.88% 15/07/2022	223.376	0,59
EUR	100.000	Bombardier Inc. 6.13% 15/05/2021	106.500	0,28	EUR	480.000	Douglas GmbH 6.25% 15/07/2022	481.846	1,27
EUR	200.000	Cott Corp. 5.50% 01/07/2024	208.849	0,55	EUR	200.000	Platin 1426 GmbH 5.38% 15/06/2023	188.457	0,50
		Total de Canadá	639.508	1,69	EUR	180.000	Safari Verwaltungs GmbH 5.38% 30/11/2022	116.435	0,31
ISLAS CAIMÁN					EUR	220.000	Thyssenkrupp AG 1.38% 03/03/2022	219.495	0,58
EUR	280.000	Petrobras International Finance Company 5.88% 07/03/2022	318.298	0,84	EUR	91.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	91.095	0,24
		Total de Islas Caimán	318.298	0,84	EUR	133.000	Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	136.342	0,36
DINAMARCA					EUR	190.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH 3.75% 15/05/2024	193.973	0,51
EUR	340.000	TDC A/S 5.00% 02/03/2022	375.979	0,99			Total de Alemania	2.361.759	6,24
		Total de Dinamarca	375.979	0,99	IRLANDA				
FINLANDIA					EUR	580.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.13% 15/05/2023	593.347	1,57
EUR	420.000	Nokia Oyj 1.00% 15/03/2021	425.840	1,13	EUR	100.000	Smurfit Kappa Acquisitions 2.38% 01/02/2024	108.181	0,29
		Total de Finlandia	425.840	1,13	EUR	200.000	Smurfit Kappa Acquisitions 4.13% 30/01/2020	202.976	0,53
FRANCIA					EUR	100.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 3.25% 01/06/2021	104.637	0,28
EUR	124.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	126.067	0,33	GBP	630.000	Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC 5.75% 15/04/2023	732.022	1,94
EUR	270.000	Altice France SA 5.63% 15/05/2024	278.708	0,74			Total de Irlanda	1.741.163	4,61
EUR	300.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	277.963	0,73	ISLA DE MAN				
EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.98% 26/05/2021	102.987	0,27	EUR	210.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	219.576	0,58
EUR	350.000	Crown European Holdings 4.00% 15/07/2022	382.797	1,01			Total de Isla de Man	219.576	0,58
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	105.650	0,28					
EUR	400.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	415.347	1,10					
EUR	220.000	Faurecia SE 3.63% 15/06/2023	224.348	0,59					
EUR	410.000	Getlink SE 3.63% 01/10/2023	428.648	1,14					
EUR	150.000	La Financiere Atalian SAS 4.00% 15/05/2024	110.808	0,29					
EUR	200.000	Loxam SAS 3.50% 15/04/2022	203.990	0,54					
EUR	100.000	Loxam SAS 3.50% 03/05/2023	101.961	0,27					
EUR	310.000	Rexel SA 2.63% 15/06/2024	317.420	0,84					
EUR	200.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	215.774	0,57					
		Total de Francia	3.292.468	8,70					

*Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)					
ITALIA					LUXEMBURGO (continuación)					
EUR	200.000	International Game Technology plc 4.75% 05/03/2020	204.085	0,54	EUR	160.000	Dufry Finance SCA 4.50% 01/08/2023	164.318	0,43	
EUR	250.000	Lkq Italia Bondco SpA 3.88% 01/04/2024	283.385	0,75	EUR	125.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 22/03/2021	133.500	0,35	
EUR	261.000	Nexi Capital SpA 4.13% 01/11/2023	268.822	0,71	EUR	320.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 6.75% 14/10/2019	320.690	0,85	
EUR	577.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	607.654	1,61	EUR	220.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	210.232	0,56	
Total de Italia			1.363.946	3,61	EUR	160.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	154.744	0,41	
					EUR	185.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	189.576	0,50	
JAPÓN	EUR	430.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	461.691	1,22	EUR	250.000	Leonardo SpA 5.25% 21/01/2022	279.065	0,74
EUR	125.000	Softbank Group Corp. 4.00% 30/07/2022	134.733	0,36	GBP	300.000	Leonardo SpA 8.00% 16/12/2019	343.635	0,91	
Total de Japón			596.424	1,58	EUR	250.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	259.327	0,69	
					EUR	200.000	Swissport Financing Sarl 5.25% 15/08/2024	207.796	0,55	
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					EUR	100.000	Takko Luxembourg 2 SCA 5.38% 15/11/2023	95.432	0,25	
EUR	399.570	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	416.967	1,10	Total de Luxemburgo			4.469.299	11,82	
Total de Jersey - Islas del Canal			416.967	1,10						
LUXEMBURGO					PAÍSES BAJOS					
EUR	190.000	Altice Financing SA 5.25% 15/02/2023	196.019	0,52	EUR	150.000	Hertz Holdings Netherlands BV 5.50% 30/03/2023	157.344	0,42	
USD	200.000	Altice Finco SA 8.13% 15/01/2024	189.775	0,50	GBP	200.000	Intergen NV 7.50% 30/06/2021	224.273	0,59	
EUR	248.771	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/05/2022	254.171	0,67	EUR	350.000	OI European Group BV 4.88% 31/03/2021	374.205	0,99	
EUR	100.000	ARD Finance SA 6.63% 15/09/2023	103.625	0,27	EUR	175.000	OI European Group BV 6.75% 15/09/2020	185.821	0,49	
GBP	150.000	B&M European Value Retail SA 4.13% 01/02/2022	172.714	0,46	EUR	160.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 0.38% 25/07/2020	156.116	0,41	
EUR	270.000	BMBG Bond Finance SCA 3.00% 15/06/2021	271.843	0,72	EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	84.049	0,22	
EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	106.555	0,28	EUR	200.000	United Group BV 4.38% 01/07/2022	204.737	0,54	
EUR	200.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	198.064	0,52	EUR	200.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	209.294	0,55	
EUR	250.000	CPI Property Group SA 1.45% 14/04/2022	256.082	0,68	Total de Países Bajos			1.595.839	4,21	
EUR	350.000	Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	362.136	0,96	ESPAÑA					
					EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 3.13% 27/07/2022	108.212	0,29	
					EUR	224.802	NH Hotel Group SA 3.75% 01/10/2023	228.573	0,60	
					Total de España			336.785	0,89	

*Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
SUECIA					REINO UNIDO (continuación)				
EUR	556.000	Intrum AB 2.75% 15/07/2022	564.289	1,49	GBP	290.000	Travis Perkins plc 4.38% 15/09/2021	341.384	0,90
EUR	92.500	Intrum AB 2.75% 15/07/2022	93.879	0,25				309.354	0,82
	Total de Suecia		658.168	1,74	EUR	300.000	Victoria plc 5.25% 15/07/2024		
					GBP	190.000	William Hill plc 4.25% 05/06/2020	220.366	0,58
REINO UNIDO					Total del Reino Unido				
EUR	200.000	Algeco Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	201.775	0,53				8.969.347	23,73
GBP	300.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	326.622	0,86	ESTADOS UNIDOS				
GBP	265.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	320.553	0,85	EUR	260.000	Ball Corp 3.50% 15/12/2020	271.160	0,72
GBP	400.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	476.792	1,27	EUR	100.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	116.585	0,31
GBP	290.000	Drax Finco plc 4.25% 01/05/2022	333.767	0,88	EUR	200.000	Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	210.484	0,56
EUR	450.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	455.707	1,21	EUR	100.000	Equinix Inc. 2.88% 15/03/2024	322.379	0,85
GBP	234.000	El Group plc 6.38% 15/02/2022	271.974	0,72				109.752	0,29
GBP	150.000	El Group plc 6.88% 15/02/2021	174.780	0,46	USD	760.000	MPT Operating Partnership LP 4.00% 19/08/2022	740.254	1,96
USD	446.809	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	338.631	0,90					
EUR	350.000	FCE Bank plc 1.88% 24/06/2021	357.714	0,95	Total de Estados Unidos				
GBP	580.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	712.361	1,88	Total de bonos				
GBP	100.000	Heathrow Finance plc 4.75% 01/03/2024	120.876	0,32	Bonos - convertibles				
EUR	445.000	International Game Technology plc 4.75% 15/02/2023	492.390	1,30	ITALIA				
GBP	110.000	Jaguar Land Rover 3.88% 01/03/2023	109.676	0,29	EUR	100.000	Telecom Italia SpA 1.13% 26/03/2022	100.825	0,27
GBP	500.000	Kelda Finance (Nb.3) 5.75% 17/02/2020	570.039	1,51	Total de Italia				
GBP	500.300	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 16/09/2022	596.267	1,58	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
EUR	360.000	Merlin Entertainments plc 2.75% 15/03/2022	383.025	1,01	GBP	500.000	British Land White 2015 Limited 0.00% 09/06/2020	558.992	1,47
EUR	450.000	OTE plc 2.38% 18/07/2022	476.879	1,26	Total de Jersey - Islas del Canal				
EUR	100.000	OTE plc 4.38% 02/12/2019	100.725	0,27	Total de bonos - convertibles				
GBP	150.000	Stonegate Pub Company Financing plc 4.88% 15/03/2022	173.929	0,46	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
GBP	175.000	Stonegate Pub Company Financing plc FRN 15/03/2022	200.193	0,53				30.313.878	80,16
EUR	320.000	Synlab Unsecured Bondco plc 8.25% 01/07/2023	334.741	0,89					
GBP	350.000	TalkTalk Telecom Group plc 5.38% 15/01/2022	405.708	1,07					
EUR	160.000	Travelex Financing plc 8.00% 15/05/2022	163.119	0,43					

*Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
13.022	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.298.839	3,43
	Total de Irlanda	1.298.839	3,43
Total de fondos		1.298.839	3,43
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		1.298.839	3,43
Valor total de las inversiones		31.612.717	83,59
(Coste total: EUR 31.661.614)			

*Consulte la nota 1.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
AUSTRALIA					FRANCIA (continuación)				
EUR	300.000	National Australia Bank Limited 0.35% 07/09/2022	304.230	0,44	EUR	700.000	CNP Assurances 1.88% 20/10/2022	737.521	1,09
Total de Australia			304.230	0,44	EUR	500.000	Credit Agricole Assurances SA Perp FRN	550.448	0,80
AUSTRIA					EUR	100.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA 0.88% 06/05/2034	111.256	0,16
EUR	600.000	Kommunalkredit Austria AG 0.38% 12/07/2021	605.491	0,88	EUR	400.000	Credit Agricole SA 0.75% 05/12/2023	413.046	0,60
EUR	700.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	763.162	1,11	EUR	300.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	320.039	0,47
Total de Austria			1.368.653	1,99	GBP	100.000	Credit Agricole SA 1.25% 02/10/2024	112.900	0,16
BÉLGICA					USD	930.000	Credit Agricole SA Perp FRN	953.288	1,40
EUR	200.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	213.460	0,31	EUR	700.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	697.008	1,02
EUR	600.000	KBC Group NV 0.88% 27/06/2023	618.720	0,90	EUR	1.000.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	1.055.762	1,54
Total de Bélgica			832.180	1,21	EUR	700.000	La Banque Postale SA 0.25% 12/07/2026	700.752	1,03
ISLAS CAIMÁN					EUR	400.000	La Banque Postale SA 1.38% 24/04/2029	429.397	0,63
GBP	200.000	Dwr Cymru Financing Limited 6.02% 31/03/2028	313.221	0,46	GBP	300.000	Orange SA 3.25% 15/01/2032	384.972	0,56
Total de Islas Caimán			313.221	0,46	GBP	465.000	Orange SA Perp FRN	573.243	0,84
DINAMARCA					EUR	200.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	188.225	0,27
EUR	310.000	ISS Global A/S 2.13% 02/12/2024	338.823	0,49	EUR	800.000	RATP 0.88% 25/05/2027	865.577	1,27
EUR	200.000	Nykredit Realkredit A/S 0.88% 17/01/2024	205.242	0,30	EUR	200.000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	239.688	0,35
EUR	200.000	Orsted A/S 1.50% 26/11/2029	223.777	0,33	EUR	100.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	111.039	0,16
GBP	308.000	Orsted A/S 2.13% 17/05/2027	368.639	0,54	EUR	200.000	SNCF Réseau 0.88% 22/01/2029	215.684	0,31
EUR	465.000	Orsted A/S Perp FRN	492.551	0,72	EUR	400.000	SNCF Réseau 2.25% 20/12/2047	544.883	0,80
GBP	259.000	Orsted A/S 2.50% 16/05/2033	319.312	0,47	EUR	300.000	Societe Generale SA 0.75% 25/11/2020	303.655	0,44
Total de Dinamarca			1.948.344	2,85	EUR	465.000	Unibail-Rodamco 1.00% 14/03/2025	489.262	0,71
FRANCIA					EUR	600.000	Unibail-Rodamco SE Perp FRN	637.871	0,93
EUR	400.000	Axa SA FRN 28/05/2049	453.764	0,66	Total de Francia			15.188.438	22,19
EUR	300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	310.724	0,45	ALEMANIA				
GBP	100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.50% 07/10/2026	112.431	0,16	EUR	525.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	566.454	0,83
GBP	500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19/12/2024	577.956	0,84	EUR	300.000	Deutsche Apotheker- und Aerztebank 0.15% 07/03/2023	306.757	0,45
EUR	400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 18/06/2029	431.057	0,63	EUR	400.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	439.080	0,64
EUR	200.000	BNP Paribas 0.50% 01/06/2022	203.913	0,30					
EUR	583.000	BNP Paribas 1.00% 17/04/2024	605.306	0,88					
EUR	800.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	821.537	1,21					
EUR	900.000	BPCE SA 2.88% 22/04/2026	1.036.234	1,52					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ALEMANIA (continuación)					LUXEMBURGO				
EUR	400.000	Deutsche Wohnen AG 1.38% 24/07/2020	404.519	0,59	EUR	248.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	256.275	0,37
EUR	433.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	426.604	0,62			Total de Luxemburgo	256.275	0,37
EUR	900.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	958.313	1,39					
EUR	400.000	Landesbank Baden- Wuerttemberg 0.38% 30/09/2027	399.324	0,58	PAÍSES BAJOS				
EUR	182.000	NRW Bank 0.75% 30/06/2028	198.677	0,29	EUR	200.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	204.782	0,30
EUR	500.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	530.989	0,78	EUR	200.000	Alliander NV 0.88% 24/06/2032	212.789	0,31
EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	98.061	0,14	EUR	600.000	Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	679.297	0,99
EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	196.260	0,29	EUR	410.000	Deutsche Bahn Finance BV 2.00% 20/02/2023	443.000	0,65
Total de Alemania			4.525.038	6,60	EUR	200.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	214.270	0,31
					EUR	400.000	Enexis Holding NV 0.88% 28/04/2026	423.693	0,62
					EUR	300.000	Iberdrola International BV Perp FRN	329.071	0,48
IRLANDA					EUR	200.000	Iberdrola International BV Perp FRN	205.615	0,30
EUR	100.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	107.449	0,16	EUR	200.000	Iberdrola International BV Perp FRN	212.817	0,31
EUR	400.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	429.795	0,63	EUR	300.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	361.407	0,53
EUR	200.000	Gas Networks Ireland 1.38% 05/12/2026	217.722	0,32	EUR	849.000	Innogy Finance BV 1.25% 19/10/2027	913.766	1,33
EUR	364.000	Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	388.321	0,57	EUR	300.000	Rabobank 1.38% 03/02/2027	329.796	0,48
EUR	200.000	Transmission Finance 1.50% 24/05/2023	210.836	0,31	EUR	182.000	Roche Finance Europe BV 0.50% 27/02/2023	186.552	0,27
Total de Irlanda			1.354.123	1,99	EUR	200.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	224.236	0,33
					EUR	1.111.000	TenneT Holding BV Perp FRN	1.189.396	1,74
ITALIA					EUR	200.000	Vesteda Finance BV 1.50% 24/05/2027	213.712	0,31
EUR	200.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	209.339	0,31	EUR	450.000	Vesteda Finance BV 2.00% 10/07/2026	494.837	0,73
EUR	400.000	Assicurazioni Generali SpA 2.12% 01/10/2030	406.000	0,59			Total de Países Bajos	6.839.036	9,99
EUR	546.000	ERG SpA 1.88% 11/04/2025	577.431	0,84					
EUR	400.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	413.544	0,60	NORUEGA				
EUR	646.000	Intesa Sanpaolo SpA 0.88% 27/06/2022	660.327	0,96	EUR	365.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	386.076	0,56
EUR	200.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 23/07/2023	208.052	0,30			Total de Noruega	386.076	0,56
EUR	100.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 1.00% 10/04/2026	105.140	0,15					
Total de Italia			2.579.833	3,75					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)			
ESPAÑA				REINO UNIDO (continuación)			
EUR	800.000	Banco Bilbao Vizcaya		GBP	182.000	Wellcome Trust Finance plc	
		Argentaria SA 1.38% 14/05/2025	850.853			4.75% 28/05/2021	218.826
EUR	200.000	CaixaBank SA 0.63% 01/10/2024	200.442	EUR	546.000	WellCome Trust Limited 1.13%	
EUR	200.000	Iberdrola Finanzas SA 1.25%				21/01/2027	591.640
		28/10/2026	215.881	GBP	115.000	Western Power Distribution	
EUR	200.000	NorteGas Energia Distribucion				South Wales plc 9.25%	
		0.92% 28/09/2022	204.701			09/11/2020	141.350
EUR	600.000	Telefonica Emisiones SA 1.07%		GBP	200.000	Yorkshire Building Society FRN	
		05/02/2024	624.021			18/04/2025	231.872
		Total de España	2.095.898			Total del Reino Unido	4.493.052
			3,07				6,56
SUPRANACIONAL				ESTADOS UNIDOS			
GBP	25.000	International Finance Corp		EUR	365.000	Becton Dickinson and	
		1.25% 15/12/2023	29.004			Company 1.40% 24/05/2023	379.372
		Total de supranacional	29.004			Total de Estados Unidos	379.372
			0,04				0,56
SUECIA				Total de bonos			
EUR	1.158.000	Akelius Residential 1.13%				44.603.612	65,14
		14/03/2024	1.191.642				
EUR	400.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	417.892	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
EUR	100.000	Nordea Bank AB 0.30%		BÉLGICA			
		30/06/2022	101.305	EUR	625.000	Belgium (Govt of) 1.25%	
		Total de Suecia	1.710.839			22/04/2033	738.091
			2,51	EUR	200.000	Flemish Community 1.50%	
						12/07/2038	241.463
REINO UNIDO				EUR	300.000	Region Wallonne Belgium	
GBP	100.000	Accent Capital plc 2.63%				1.25% 03/05/2034	343.263
		18/07/2049	124.181			Total de Bélgica	1.322.817
GBP	546.000	Anglian Water Services					1,92
		Financing plc 1.63% 10/08/2025	628.863	FINLANDIA			
GBP	100.000	British Telecommunications plc		EUR	400.000	Municipality Finance plc 0.05%	
		5.75% 07/12/2028	146.965			06/09/2029	411.684
GBP	200.000	BUPA Finance plc 5.00%				Total de Finlandia	411.684
		08/12/2026	256.421				0,60
USD	730.000	HSBC Holdings plc FRN					
		22/11/2023	679.384	FRANCIA			
EUR	546.000	Motability Operation 0.88%		EUR	400.000	Agence Francaise de	
		14/03/2025	569.885			Developpement 0.50%	
EUR	524.000	Motability Operations Group				31/10/2025	418.856
		plc 0.38% 03/01/2026	526.096	EUR	400.000	Caisse des Depots et	
EUR	100.000	NGG Finance plc FRN				Consignations 0.00% 19/06/2024	409.555
		05/09/2082	99.491	EUR	400.000	Caisse Francaise de	
GBP	40.000	Retail Charity Bonds plc 5.00%				Financement Local 0.50%	
		12/04/2026	50.392			19/02/2027	422.976
GBP	200.000	Scottish Hydro Electric		EUR	1.000.000	City of Paris France 1.38%	
		Transmission plc 2.25%				20/11/2034	1.172.923
		27/09/2035	227.686				1,71

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
FRANCIA (continuación)					PAÍSES BAJOS (continuación)				
EUR	100.000	France (Govt of) OAT 1.75% 25/06/2039	129.905	0,19	EUR	365.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 28/05/2027	377.996	0,55
EUR	100.000	Ile de France (Region of) 0.50% 14/06/2025	105.180	0,15	EUR	150.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.25% 07/06/2024	155.457	0,23
EUR	700.000	Ile de France (Region of) 3.63% 27/03/2024	829.652	1,21	EUR	450.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	558.121	0,81
EUR	200.000	Unedic Asseo 1.25% 25/05/2033	232.339	0,34	EUR	250.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	281.893	0,41
Total de Francia			3.721.386	5,43	Total de Países Bajos			2.007.712	2,93
ALEMANIA					POLONIA				
EUR	284.000	Free and Hanseatic City of Hamburg 1.45% 05/11/2038	350.153	0,51	EUR	400.000	Poland (Govt of) 1.13% 07/08/2026	436.823	0,64
EUR	200.000	Investitionsbank Schleswig-Holstein 0.50% 13/06/2025	210.656	0,31	Total de Polonia			436.823	0,64
GBP	100.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	114.612	0,17	ESPAÑA				
EUR	300.000	Land Berlin 0.63% 15/07/2039	324.457	0,47	EUR	821.000	Autonomous Community of Madrid 0.75% 30/04/2022	843.650	1,23
EUR	600.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.25% 15/07/2024	623.232	0,91	EUR	1.000.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	1.123.036	1,65
EUR	511.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.38% 14/02/2028	543.033	0,79	EUR	60.000	Basque (Government) 1.13% 30/04/2029	65.337	0,10
EUR	182.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.50% 28/02/2029	196.324	0,29	EUR	894.000	Instituto de Credito Oficial 0.10% 30/07/2021	902.370	1,31
EUR	830.000	Nordrhein-Westfalen Land 0.95% 13/03/2028	919.739	1,34	EUR	450.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	469.213	0,69
EUR	128.000	NRW. Bank 0.88% 10/11/2025	138.348	0,20	Total de España			3.403.606	4,98
EUR	92.000	State of Lower Saxony 0.88% 25/10/2028	101.677	0,15	SUPRANACIONAL				
Total de Alemania			3.522.231	5,14	EUR	930.000	African Development Bank 0.25% 21/11/2024	966.689	1,41
IRLANDA					EUR	875.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	917.866	1,34
EUR	585.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	668.246	0,98	EUR	201.000	Council of Europe Development Bank 0.13% 10/04/2024	207.405	0,30
Total de Irlanda			668.246	0,98	EUR	1.265.000	European Investment Bank 0.38% 15/05/2026	1.339.437	1,96
ITALIA					GBP	500.000	European Investment Bank 0.75% 15/11/2024	568.494	0,84
EUR	1.300.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 0.75% 21/11/2022	1.327.049	1,94	USD	325.000	Inter-American Development Bank 3.00% 26/09/2022	308.688	0,45
EUR	500.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	547.973	0,80	USD	100.000	Inter-American Investment Corp. 1.75% 02/10/2024	91.521	0,13
Total de Italia			1.875.022	2,74	USD	195.000	Inter-American Investment Corp. FRN 12/10/2021	178.915	0,26
PAÍSES BAJOS									
EUR	207.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0.05% 13/07/2024	212.775	0,31					
GBP	365.000	Deutsche Bahn Finance BV 1.38% 07/07/2025	421.470	0,62					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Bonos (continuación)			
SUPRANACIONAL (continuación)			
EUR	392.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.25% 21/05/2029	413.847 0,60
USD	329.000	International Finance Corp. 1.75% 30/03/2020	301.405 0,44
Total de supranacional		5.294.267	7,73
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		22.663.794	33,09
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		67.267.406	98,23
Valor total de las inversiones		67.267.406	98,23
(Coste total: EUR 64.702.457)			

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor		
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos					Bonos (continuación)						
AUSTRALIA					FRANCIA						
EUR	1.390.000	APT Pipelines Limited 2.00% 22/03/2027	1.521.766	1,15	EUR	124.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	126.067	0,09		
GBP	160.000	APT Pipelines Limited 4.25% 26/11/2024	204.848	0,15	EUR	325.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	330.845	0,25		
EUR	840.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	975.023	0,73	EUR	601.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	666.828	0,50		
EUR	715.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	750.715	0,56	EUR	1.300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	1.346.473	1,02		
EUR	417.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	436.841	0,33	EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	92.654	0,07		
GBP	400.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	506.777	0,38	EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	95.653	0,07		
Total de Australia			4.395.970	3,30	EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.98% 26/05/2021	102.987	0,08		
BÉLGICA					EUR	100.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	93.592	0,07		
EUR	160.000	Anheuser-Busch Inbev SA 2.00% 23/01/2035	185.046	0,14	EUR	1.100.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	1.173.475	0,88		
GBP	830.000	Anheuser-Busch InBev SA 2.25% 24/05/2029	979.411	0,74	GBP	170.000	Credit Agricole SA FRN 31/12/2049	226.266	0,17		
EUR	500.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	493.745	0,37	EUR	800.000	Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	849.933	0,64		
EUR	231.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	237.052	0,18	EUR	500.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	500.085	0,37		
EUR	200.000	KBC Group NV Perp FRN	213.972	0,16	EUR	100.000	Elis SA 1.63% 03/04/2028	100.109	0,08		
Total de Bélgica			2.109.226	1,59	EUR	600.000	HSBC France SA 0.10% 03/09/2027	594.159	0,45		
BERMUDAS					EUR	100.000	Louvre Bidco SAS 4.25% 30/09/2024	101.965	0,08		
EUR	900.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	975.062	0,73	EUR	1.400.000	Orange SA 0.00% 04/09/2026	1.381.236	1,05		
Total de Bermudas			975.062	0,73	EUR	270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	254.103	0,19		
					Total de Francia					8.036.430	6,06
ISLAS CAIMÁN					ALEMANIA						
USD	633.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	632.199	0,48	EUR	700.000	ADLER Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	712.397	0,54		
Total de Islas Caimán			632.199	0,48	EUR	200.000	ADLER Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	212.229	0,16		
DINAMARCA					EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	693.301	0,52		
EUR	250.000	Danske Bank A/S 0.75% 02/06/2023	256.394	0,19	EUR	865.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	897.307	0,67		
Total de Dinamarca			256.394	0,19	EUR	440.000	Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	454.043	0,34		
FINLANDIA					EUR	182.000	Douglas GmbH 6.25% 15/07/2022	182.700	0,14		
EUR	222.000	Sampo Oyj FRN 23/05/2049	251.055	0,19	EUR	100.000	Eurogrid GmbH 1.50% 18/04/2028	109.457	0,08		
Total de Finlandia			251.055	0,19							

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ALEMANIA (continuación)					ITALIA (continuación)				
EUR	100.000	Lanxess AG FRN 06/12/2076	109.937	0,08	EUR	287.000	International Design Group SPA		
EUR	320.000	Safari Verwaltungs GmbH 5.38% 30/11/2022	206.995	0,16			6.50% 15/11/2025	295.495	0,22
EUR	310.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	294.252	0,22	EUR	437.000	Nexi Capital SpA 4.13% 01/11/2023	450.097	0,34
EUR	360.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	390.502	0,29	Total de Italia			2.370.061	1,78
EUR	700.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	686.912	0,52	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
Total de Alemania		4.950.032	3,72		EUR	155.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	165.919	0,12
					GBP	100.000	Cpuk Finance Limited 4.25% 28/08/2022	115.530	0,09
					GBP	100.000	Cpuk Finance Limited 4.88% 28/08/2025	116.800	0,09
INDIA					EUR	255.000	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	266.102	0,20
USD	560.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	477.906	0,36	Total de Jersey - Islas del Canal			664.351	0,50
Total de India		477.906	0,36						
IRLANDA					LUXEMBURGO				
EUR	370.000	AIB Group plc 1.25% 28/05/2024	378.054	0,28	USD	200.000	Altice Financing SA 6.63% 15/02/2023	188.532	0,14
EUR	700.000	AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	752.448	0,57					
EUR	243.000	Ardagh Packaging Finance 2.75% 15/03/2024	248.635	0,19	EUR	157.000	Altice Finco SA 9.00% 15/06/2023	163.362	0,12
EUR	200.000	Bank of Ireland Perp FRN	208.073	0,16	EUR	55.973	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/05/2022	57.189	0,04
EUR	455.000	Bank of Ireland Group 1.38% 29/08/2023	467.696	0,35	EUR	1.191.000	Altice Luxembourg SA 8.00% 15/05/2027	1.311.436	0,99
EUR	934.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	998.898	0,76	EUR	469.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	484.648	0,36
EUR	309.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	332.016	0,25	EUR	1.330.000	Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	1.391.311	1,04
USD	595.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	574.159	0,43	EUR	200.000	CPI Property Group SA 2.13% 04/10/2024	211.806	0,16
EUR	745.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	838.144	0,62	EUR	246.000	Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	254.530	0,19
Total de Irlanda		4.798.123	3,61		EUR	421.000	DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	422.519	0,32
					EUR	343.000	DH Europe Finance II Sarl 0.75% 18/09/2031	344.928	0,26
					EUR	402.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	384.151	0,29
ITALIA					GBP	180.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.50% 01/11/2022	192.024	0,14
EUR	245.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	287.837	0,22	EUR	400.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	417.120	0,31
EUR	200.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	203.603	0,15	EUR	300.000	Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	316.744	0,24
EUR	547.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	561.384	0,42	EUR	167.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	161.514	0,12
EUR	571.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	571.645	0,43					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor		
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)						
LUXEMBURGO (continuación)					PAÍSES BAJOS (continuación)						
EUR	300.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	336.801	0,25	USD	1.774.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	1.721.511	1,30		
EUR	615.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	630.211	0,47	EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	310.531	0,23		
EUR	180.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	186.348	0,14	EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	551.321	0,41		
EUR	281.000	LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 15/03/2024	289.384	0,22	EUR	200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	204.123	0,15		
EUR	200.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	204.464	0,15	EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	696.605	0,52		
USD	380.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	382.177	0,29	EUR	245.000	TenneT Holding BV 0.88% 03/06/2030	257.637	0,19		
EUR	1.092.000	Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	1.133.755	0,85	EUR	632.000	TenneT Holding BV 2.13% 01/11/2020	647.617	0,49		
EUR	400.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	431.497	0,32	EUR	618.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	655.124	0,49		
Total de Luxemburgo			9.896.451	7,41	EUR	211.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	220.805	0,17		
MÉXICO					EUR	400.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	523.908	0,39		
EUR	374.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	376.275	0,28	EUR	500.000	Vonovia Finance BV 0.13% 06/04/2023	501.209	0,38		
USD	364.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	347.979	0,26	EUR	400.000	Ziggo Bond Finance BV FRN 15/01/2025	412.580	0,31		
Total de México			724.254	0,54	Total de Países Bajos					13.544.826	10,18
PAÍSES BAJOS					NORUEGA						
EUR	352.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	360.416	0,27	EUR	650.000	DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	657.008	0,49		
EUR	700.000	Bayer Capital Corp BV 1.50% 26/06/2026	744.146	0,56	Total de Noruega					657.008	0,49
EUR	550.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	585.217	0,44	ESPAÑA						
EUR	875.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	908.021	0,68	EUR	300.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 18/01/2029	323.776	0,24		
EUR	486.000	Enexis Holding NV 1.50% 20/10/2023	516.789	0,39	EUR	400.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	429.355	0,32		
GBP	570.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	898.607	0,68	EUR	800.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	833.823	0,63		
EUR	344.000	LKQ Euro Holdings BV 3.63% 01/04/2026	361.317	0,27	EUR	500.000	Caixabank SA FRN 17/04/2030	515.050	0,39		
USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	623.791	0,47	EUR	1.166.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.266.441	0,95		
EUR	1.000.000	RELX Finance BV 0.38% 22/03/2021	1.007.155	0,76	Total de España					3.368.445	2,53
EUR	171.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	197.208	0,15	SUPRANACIONAL						
EUR	604.000	Stedin Holding NV Perp FRN	639.188	0,48	EUR	182.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	187.135	0,14		
					Total de supranacional					187.135	0,14

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
SUECIA					REINO UNIDO (continuación)				
EUR	1.101.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	1.161.018	0,87	EUR	384.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	396.645	0,30
GBP	605.000	Akelius Residential Property AB 2.38% 15/08/2025	703.904	0,53	EUR	100.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	101.268	0,08
EUR	1.958.000	Essity AB 0.50% 26/05/2021	1.978.726	1,49	USD	868.956	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	658.572	0,50
EUR	933.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	978.709	0,73	GBP	590.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	756.037	0,57
	Total de Suecia		4.822.357	3,62	EUR	220.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	226.851	0,17
SUIZA					GBP	481.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	554.346	0,42
EUR	448.000	UBS Group AG Perp FRN	491.755	0,37	GBP	111.000	GKN Holdings plc 6.75% 28/10/2019	125.923	0,09
USD	216.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	211.057	0,16	EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.226.661	0,93
	Total de Suiza		702.812	0,53	GBP	192.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	282.538	0,21
REINO UNIDO					EUR	500.000	Imperial Brands Finance plc 1.38% 27/01/2025	514.196	0,39
GBP	290.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	315.734	0,24	EUR	715.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	807.855	0,60
GBP	160.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	193.542	0,15	USD	570.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	523.077	0,39
GBP	200.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	225.604	0,17	GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	358.483	0,27
EUR	399.000	Barclays plc FRN 07/02/2028	396.150	0,30	GBP	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	106.743	0,08
EUR	410.000	Bat International Finance plc 2.75% 25/03/2025	451.567	0,34	GBP	450.000	Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	566.022	0,43
EUR	513.000	BP Capital Markets plc 0.83% 08/11/2027	532.611	0,40	GBP	200.000	Nationwide Building Society Perp FRN	231.424	0,17
EUR	500.000	British Telecommunications plc 0.63% 10/03/2021	505.259	0,38	EUR	637.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	633.756	0,48
EUR	550.000	British Telecommunications plc 1.50% 23/06/2027	577.195	0,43	GBP	502.000	Northumbrian Water Finance plc 1.63% 11/10/2026	571.445	0,43
GBP	375.000	Bunzl Finance plc 2.25% 11/06/2025	436.656	0,33	GBP	685.000	Pennon Group plc Perp FRN	779.944	0,59
GBP	1.147.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	1.470.572	1,11	GBP	250.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	301.584	0,23
EUR	698.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	712.773	0,54	EUR	300.000	Rolls-Royce plc 1.63% 09/05/2028	322.741	0,24
GBP	100.000	Cadent Finance plc 2.13% 22/09/2028	116.083	0,09	EUR	663.000	Royal Bank of Scotland FRN 02/03/2026	693.168	0,52
GBP	220.000	Cadent Finance plc 2.63% 22/09/2038	258.880	0,19	GBP	515.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 19/09/2026	601.062	0,45
GBP	134.693	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	177.791	0,13	GBP	165.000	Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	301.441	0,23
EUR	828.000	Diageo Finance plc 0.00% 17/11/2020	830.180	0,62	GBP	582.000	Severn Trent Water 3.63% 16/01/2026	741.364	0,56
EUR	674.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	707.285	0,53	GBP	170.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	199.564	0,15
EUR	1.779.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	1.757.747	1,33	GBP	261.389	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	433.563	0,33

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
REINO UNIDO (continuación)					ESTADOS UNIDOS (continuación)				
GBP	1.160.886	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.711.340	1,28	EUR	305.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	313.353	0,24
GBP	712.000	Tsb Banking Group plc FRN 06/05/2026	816.734	0,61	EUR	300.000	IQVIA Inc. 3.50% 15/10/2024	306.271	0,23
GBP	345.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.88% 15/01/2027	406.526	0,31	EUR	390.000	Iron Mountain Inc. 3.00% 15/01/2025	400.594	0,30
GBP	116.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.13% 15/01/2025	135.850	0,10	EUR	905.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	965.071	0,73
GBP	100.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	121.594	0,09	GBP	648.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	801.947	0,60
EUR	332.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	379.391	0,29	EUR	514.000	Metropolitan Life Global Funding I 0.38% 09/04/2024	521.617	0,39
USD	650.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	644.834	0,48	EUR	850.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	882.965	0,66
GBP	405.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	491.052	0,37	EUR	507.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	539.233	0,41
		Total del Reino Unido	27.389.223	20,62	EUR	1.113.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	1.183.252	0,88
					EUR	243.000	Refinitiv US Holdings Inc. 4.50% 15/05/2026	262.303	0,20
					EUR	200.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	205.487	0,15
					EUR	574.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	607.023	0,46
ESTADOS UNIDOS					EUR	525.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	527.819	0,40
EUR	203.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	247.180	0,19	EUR	288.000	UGI International LLC 3.25% 01/11/2025	305.480	0,23
EUR	330.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	353.409	0,27	EUR	723.000	Verizon Communications Inc. 0.88% 08/04/2027	746.787	0,57
EUR	400.000	BAT Capital Corp. 1.13% 16/11/2023	409.651	0,31			Total de Estados Unidos	19.374.372	14,60
USD	400.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	371.278	0,28					
EUR	400.000	Becton Dickinson and Company 1.90% 15/12/2026	429.942	0,32	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				
GBP	1.206.000	Becton Dickinson and Company 3.02% 24/05/2025	1.455.525	1,10	EUR	340.000	Global Switch Holdings Limited 2.25% 31/05/2027	370.876	0,28
GBP	290.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 2.63% 19/06/2059	384.473	0,29	USD	390.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	378.511	0,28
USD	457.000	Broadcom Cayman Finance 3.63% 15/01/2024	428.588	0,32			Total de Islas Vírgenes (Británicas)	749.387	0,56
EUR	1.413.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	1.559.713	1,18	Total de bonos			111.333.079	83,73
EUR	305.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	336.668	0,25	Valores respaldados por hipotecas y activos				
EUR	475.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	493.360	0,37	SENEGAL				
EUR	302.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	315.277	0,24	EUR	350.000	Senegal (Govt of) 4.75% 13/03/2028	364.416	0,27
USD	80.000	Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	79.160	0,06			Total de Senegal	364.416	0,27
EUR	828.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	887.452	0,66	Total de valores respaldados por hipotecas y activos			364.416	0,27
EUR	675.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	833.386	0,63					
EUR	585.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	609.362	0,46					
EUR	346.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	372.824	0,28					
EUR	507.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	523.244	0,40					
EUR	700.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	714.678	0,54					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
BÉLGICA					ESPAÑA				
EUR	325.000	Kingdom of Belgium (Govt of)			EUR	1.639.000	Spain (Govt of)	1.847.710	1,39
		1.70% 22/06/2050	431.885	0,32	EUR	485.000	Spain (Govt of)	703.108	0,53
Total de Bélgica			431.885	0,32	Total de España			2.550.818	1,92
REPÚBLICA DOMINICANA					Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	630.000	Dominican Republic (Govt of)						12.198.748	9,17
		5.95% 25/01/2027	625.943	0,47	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
Total de República Dominicana			625.943	0,47				123.896.243	93,17
EGIPTO					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
EUR	283.000	Egypt (Govt of)	290.868	0,22	Bonos				
Total de Egipto			290.868	0,22	BERMUDAS				
FRANCIA					USD	1.950.000	Bacardi Limited		
EUR	700.000	Agence Francaise de Developpement					15/05/2025	1.912.096	1,45
		0.50% 31/10/2025	732.998	0,55	USD	440.000	Bacardi Limited		
EUR	3.000.000	France (Govt of)					15/05/2028	440.534	0,33
		OAT 1.75% 25/06/2039	3.897.141	2,93	Total de Bermudas			2.352.630	1,78
Total de Francia			4.630.139	3,48	DINAMARCA				
ITALIA					USD	500.000	Danske Bank A/S		
EUR	1.562.000	Italy (Govt of)					02/03/2022	461.091	0,35
		BPT 2.70% 01/03/2047	1.887.332	1,42	Total de Dinamarca			461.091	0,35
Total de Italia			1.887.332	1,42	FRANCIA				
COSTA DE MARFIL					USD	1.100.000	BPCE SA	1.004.344	0,76
EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of)			USD	420.000	Electricite de France		
		5.25% 22/03/2030	251.877	0,19			22/01/2044	448.870	0,34
Total de Costa de Marfil			251.877	0,19	USD	200.000	Electricite de France SA		
OMÁN							21/09/2038	214.986	0,16
USD	1.300.000	Oman (Govt of)			Total de Francia			1.668.200	1,26
		6.00% 01/08/2029	1.188.765	0,89	ITALIA				
Total de Omán			1.188.765	0,89	USD	400.000	Intesa Sanpaolo SpA		
CATAR							23/09/2029	366.859	0,28
USD	300.000	Qatar (Govt of)	341.121	0,26	Total de Italia			366.859	0,28
Total de Catar			341.121	0,26	PAÍSES BAJOS				
					USD	467.000	Vonovia Finance BV		
							02/10/2023	461.815	0,35
					Total de Países Bajos			461.815	0,35

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)			
ESTADOS UNIDOS			
USD	700.000 Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	666.712	0,50
	Total de Estados Unidos	666.712	0,50
Total de bonos		5.977.307	4,52
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		5.977.307	4,52
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Bonos			
PORTUGAL			
EUR	100.000 Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	20.878	0,02
	Total de Portugal	20.878	0,02
REINO UNIDO			
GBP	395.000 Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	456.160	0,33
	Total del Reino Unido	456.160	0,33
Total de bonos		477.038	0,35
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		477.038	0,35
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
6.983	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	696.543	0,52
	Total de Irlanda	696.543	0,52
Total de fondos		696.543	0,52
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		696.543	0,52
Valor total de las inversiones		131.047.131	98,56
(Coste total: EUR 125.381.840)			

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
ARGENTINA					COLOMBIA				
USD	195.000	YPF SA 8.50% 28/07/2025	152.315	0,39	USD	255.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	284.102	0,73
Total de Argentina			152.315	0,39	Total de Colombia			284.102	0,73
BERMUDAS					HONG KONG				
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	204.406	0,52	USD	200.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 3.38% 19/06/2024	201.823	0,52
USD	500.000	Li & Fung Limited 4.38% 04/10/2024	500.248	1,28	USD	440.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 4.63% 14/03/2023	461.578	1,18
USD	400.000	Ooredoo International Finance Limited 3.25% 21/02/2023	409.265	1,05	Total de Hong Kong			663.401	1,70
Total de Bermudas			1.113.919	2,85	INDIA				
BRASIL					USD	500.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	519.932	1,32
USD	400.000	Light Servicos de Eletricidade SA 7.25% 03/05/2023	426.700	1,09	USD	400.000	Delhi International Airport Limited 6.45% 04/06/2029	424.218	1,08
USD	800.000	Vale Overseas Limited 6.88% 21/11/2036	1.013.100	2,59	USD	500.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	465.190	1,19
Total de Brasil			1.439.800	3,68	USD	650.000	JSW Steel Limited 4.75% 12/11/2019	650.963	1,66
ISLAS CAIMÁN					USD	200.000	JSW Steel Limited 5.25% 13/04/2022	202.304	0,52
USD	450.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	514.061	1,32	USD	500.000	ReNew Power Limited 6.45% 27/09/2022	505.682	1,29
USD	200.000	China Overseas Finance Cayman VII Limited 4.25% 26/04/2023	209.977	0,54	Total de India			2.768.289	7,06
USD	700.000	Chn Aoyuan Group Limited 6.35% 11/01/2020	702.456	1,80	INDONESIA				
USD	400.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	412.511	1,05	USD	314.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	407.324	1,04
USD	743.000	Comunicaciones Celulares SA Via Comcel Trust 6.88% 06/02/2024	767.679	1,95	USD	398.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	400.764	1,03
USD	1.000.000	Lenovo Perpetual Securities Limited FRN	983.750	2,52	Total de Indonesia			808.088	2,07
USD	500.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	490.516	1,25	IRLANDA				
USD	400.000	MGM China Holdings Limited 5.38% 15/05/2024	413.997	1,06	USD	350.000	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital SA 6.00% 27/11/2023	388.856	0,99
USD	355.000	Mumtalakat Sukuk Holding Company 5.63% 27/02/2024	370.801	0,95	USD	288.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.95% 24/04/2023	295.875	0,76
USD	400.000	Sands China Limited 5.40% 08/08/2028	451.742	1,16	Total de Irlanda			684.731	1,75
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 4.53% 11/04/2049	239.500	0,61	KAZAJISTÁN				
Total de Islas Caimán			5.556.990	14,21	USD	350.000	KazMunayGas National Company JSC 6.38% 24/10/2048	436.690	1,12
					Total de Kazajistán			436.690	1,12

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)						
LUXEMBURGO					MARRUECOS						
USD	630.000	Gaz Capital for Gazprom OAO 6.51% 07/03/2022	686.179	1,75	USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	692.768	1,76		
USD	680.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	711.380	1,81	Total de Marruecos					692.768	1,76
USD	400.000	MHP SE 7.75% 10/05/2024	429.978	1,10	PAÍSES BAJOS						
USD	405.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	444.061	1,14	USD	375.000	Equate Petrochemical BV 3.00% 03/03/2022	377.470	0,97		
USD	351.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.88% 18/01/2025	371.975	0,95	USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	509.788	1,30		
Total de Luxemburgo			2.643.573	6,75	USD	524.000	Petrobras Global Finance BV 5.75% 01/02/2029	577.579	1,48		
					USD	500.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	530.632	1,36		
MALASIA					USD	650.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.80% 21/07/2023	526.094	1,35		
USD	442.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	425.692	1,09	Total de Países Bajos					2.521.563	6,46
Total de Malasia			425.692	1,09							
MAURICIO					PERÚ						
USD	400.000	Azure Power Solar Energy Pvt Limited 5.65% 24/12/2024	401.000	1,03	USD	200.000	Hunt Oil Companyof Peru LLC Sucursal del Peru 6.38% 01/06/2028	224.149	0,57		
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	400.483	1,02	USD	891.000	Inretail Pharma SA 5.38% 02/05/2023	936.106	2,39		
USD	530.000	HTA Group Limited 9.13% 08/03/2022	554.022	1,42	USD	500.000	Volcan Compania Minera SAA 5.38% 02/02/2022	516.438	1,33		
Total de Mauricio			1.355.505	3,47	Total de Perú					1.676.693	4,29
MÉXICO					REPÚBLICA DE COREA (SUR)						
USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	500.625	1,28	USD	200.000	SK Hynix Inc. 3.00% 17/09/2024	199.416	0,51		
USD	400.000	Cemex SAB De CV 7.75% 16/04/2026	435.250	1,11	Total de República de Corea (Sur)					199.416	0,51
USD	400.000	Elementia SAB de CV 5.50% 15/01/2025	390.982	1,00							
USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	257.030	0,66	SINGAPUR						
USD	512.000	Grupo Posadas SAB de CV 7.88% 30/06/2022	513.216	1,31	USD	200.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	213.033	0,54		
USD	400.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	372.714	0,95	USD	220.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	163.833	0,42		
USD	200.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 23/01/2029	203.391	0,52	USD	500.000	Golden Legacy Pte Limited 6.88% 27/03/2024	508.435	1,30		
USD	300.000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047	287.513	0,74	USD	200.000	Medco Oak Tree Pte Limited 7.38% 14/05/2026	202.371	0,52		
Total de México			2.960.721	7,57	USD	250.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	242.060	0,62		
					Total de Singapur					1.329.732	3,40

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
SUDÁFRICA					ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS) (continuación)				
USD	494.000	Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	499.249	1,28	USD	500.000	Hysan MTN Limited 2.82% 04/09/2029	483.758	1,24
	Total de Sudáfrica		499.249	1,28	USD	500.000	Shanghai Port Group BVI Development Company Limited 3.38% 18/06/2029	517.136	1,32
TAILANDIA					USD	500.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	514.032	1,31
USD	700.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	709.377	1,82	USD	200.000	Studio City Company Limited 7.25% 30/11/2021	204.022	0,52
USD	200.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	200.343	0,51	USD	250.000	Studio City Finance Limited 7.25% 11/02/2024	263.722	0,67
	Total de Tailandia		909.720	2,33	Total de Islas Vírgenes (Británicas)			3.222.208	8,23
TURQUÍA					Total de bonos			35.474.908	90,69
USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	389.834	0,99	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	300.000	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS 5.88% 12/08/2020	300.750	0,77	ARGENTINA				
USD	387.000	Turkiye Garanti Bankasi AS 5.88% 16/03/2023	389.841	1,00	USD	1.500.000	Argentina (Govt of) 4.63% 11/01/2023	628.124	1,61
	Total de Turquía		1.080.425	2,76	Total de Argentina			628.124	1,61
EMIRATOS ÁRABES UNIDOS					REPÚBLICA DOMINICANA				
USD	385.000	Emirates NBD PJSC Perp FRN	404.595	1,03	USD	151.000	Dominican (Govt) 6.40% 05/06/2049	161.247	0,41
	Total de Emiratos Árabes Unidos		404.595	1,03	Total de República Dominicana			161.247	0,41
REINO UNIDO					CATAR				
USD	500.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	495.504	1,27	USD	350.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	388.252	0,99
USD	374.000	MARB BondCo plc 6.88% 19/01/2025	391.251	1,00	Total de Catar			388.252	0,99
USD	380.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	388.550	0,99	SUDÁFRICA				
USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	369.418	0,94	USD	780.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	788.775	2,02
	Total del Reino Unido		1.644.723	4,20	Total de Sudáfrica			788.775	2,02
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	250.000	CNOOC Finance 2013 Limited 2.88% 30/09/2029	249.285	0,64				1.966.398	5,03
USD	250.000	ENN Clean Energy International Investment Limited 7.50% 27/02/2021	257.813	0,66	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				
USD	400.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	423.234	1,08				37.441.306	95,72
USD	311.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	309.206	0,79					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
1.214.498	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.214.498	3,11
	Total de Irlanda	1.214.498	3,11
Total de fondos		1.214.498	3,11
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		1.214.498	3,11
Valor total de las inversiones		38.655.804	98,83
(Coste total: USD 37.639.988)			

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión							
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)								
Bonos					Bonos (continuación)								
ISLAS CAIMÁN					MARRUECOS								
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	285.589	0,52	USD	250.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	310.938	0,57				
USD	200.000	CK Hutchison International 19 II Limited 3.38% 06/09/2049	202.520	0,37	Total de Marruecos					310.938	0,57		
USD	1.000.000	Lenovo Perpetual Securities Limited FRN	983.750	1,80	PAÍSES BAJOS								
Total de Islas Caimán					1.471.859	2,69	USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	254.894	0,47		
INDONESIA					Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028					859.623	1,57		
USD	375.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	486.454	0,89	USD	810.000	Syngenta Finance NV 5.68% 24/04/2048	260.434	0,48				
Total de Indonesia					486.454	0,89	Total de Países Bajos					1.374.951	2,52
KAZAJISTÁN					ARABIA SAUDÍ								
USD	567.000	KazMunayGas National Company JSC 5.38% 24/04/2030	636.812	1,17	USD	700.000	Saudi Arabian Oil Company 4.38% 16/04/2049	765.175	1,40				
Total de Kazajistán					636.812	1,17	USD	150.000	Saudi Arabian Oil Company 4.38% 16/04/2049	163.966	0,30		
LUXEMBURGO					SINGAPUR								
USD	565.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	619.492	1,14	USD	340.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	253.196	0,46				
Total de Luxemburgo					619.492	1,14	USD	300.000	Golden Legacy Pte Limited 6.88% 27/03/2024	305.061	0,56		
MÉXICO					Medco Oak Tree Pte Limited 7.38% 14/05/2026					222.608	0,41		
USD	400.000	Cemex SAB De CV 7.75% 16/04/2026	435.250	0,80	Total de Singapur					780.865	1,43		
USD	400.000	Elementia SAB de CV 5.50% 15/01/2025	390.982	0,72	SUDÁFRICA								
USD	350.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	343.882	0,63	USD	400.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	412.954	0,76				
USD	1.287.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	1.199.208	2,19	Total de Sudáfrica					412.954	0,76		
USD	300.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 23/01/2029	305.087	0,56	REINO UNIDO								
USD	600.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 02/06/2041	575.050	1,05	USD	260.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	257.662	0,47				
USD	345.000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047	330.639	0,61	Total del Reino Unido					257.662	0,47		
USD	750.000	Petroleos Mexicanos 6.84% 23/01/2030	777.105	1,42	ESTADOS UNIDOS								
USD	220.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	229.554	0,42	USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	371.054	0,68				
Total de México					4.586.757	8,40	Total de Estados Unidos					371.054	0,68
												371.054	0,68

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					BIELORRUSIA				
USD	300.000	CNOOC Finance 2013 Limited 2.88% 30/09/2029	299.141	0,55	USD	600.000	Belarus (Govt of) 6.20% 28/02/2030	633.299	1,16
USD	250.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	264.521	0,48	Total de Bielorrusia			633.299	1,16
USD	800.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	822.452	1,50	BRASIL				
USD	500.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Limited 4.13% 12/09/2025	540.834	0,99	USD	1.530.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	1.591.757	2,92
		State Grid Overseas Investment Limited 3.50% 04/05/2027	257.398	0,47	USD	769.000	Brazil (Govt of) 5.63% 07/01/2041	862.072	1,58
USD	244.000	Studio City Company Limited 7.25% 30/11/2021	204.022	0,37	BRL	2.020	Brazil (Govt of) 10.00% 01/01/2025	555.941	1,02
Total de Islas Vírgenes (Británicas)			2.388.368	4,36	Total de Brasil			3.009.770	5,52
Total de bonos			14.627.307	26,78	CROACIA				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					USD	620.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	713.014	1,31
					Total de Croacia			713.014	1,31
ANGOLA					REPÚBLICA DOMINICANA				
USD	300.000	Angola (Govt of) 8.25% 09/05/2028	311.498	0,57	USD	355.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 27/01/2045	398.022	0,73
Total de Angola			311.498	0,57	USD	434.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	515.158	0,94
ARGENTINA					DOP	20.700.000	Dominican Republic (Govt of) 9.75% 05/06/2026	406.687	0,74
USD	1.400.000	Argentina (Govt of) 5.88% 11/01/2028	575.237	1,05	DOP	31.600.000	Dominican Republic (Govt of) 11.25% 05/02/2027	666.490	1,22
USD	650.000	Argentine (Govt of) 6.63% 06/07/2028	271.282	0,50	DOP	23.700.000	Dominican Republic (Govt of) 11.50% 10/05/2024	502.133	0,92
USD	289.000	Argentina (Govt of) 6.88% 26/01/2027	122.563	0,22	Total de República Dominicana			2.488.490	4,55
USD	365.000	Argentina (Govt of) 6.88% 11/01/2048	155.187	0,28	ECUADOR				
USD	436.000	Argentine (Govt of) 7.13% 06/07/2036	186.563	0,34	USD	580.000	Ecuador (Govt of) 9.65% 13/12/2026	613.089	1,12
Total de Argentina			1.310.832	2,39	Total de Ecuador			613.089	1,12
BARÉIN					EGIPTO				
USD	350.000	Bahrain (Govt of) 7.00% 26/01/2026	393.548	0,72	USD	600.000	Egypt (Govt of) 6.59% 21/02/2028	607.215	1,11
Total de Bahrein			393.548	0,72	USD	375.000	Egypt (Govt of) 8.50% 31/01/2047	398.363	0,73
					Total de Egipto			1.005.578	1,84
					EL SALVADOR				
					USD	150.000	El Salvador (Govt of) 7.12% 20/01/2050	153.497	0,28
					Total de El Salvador			153.497	0,28

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
GHANA					OMÁN (continuación)				
USD	200.000	Ghana (Govt of) 8.13% 26/03/2032	201.419	0,37	USD	557.000	Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	526.557	0,96
Total de Ghana			201.419	0,37	Total de Omán			1.342.039	2,45
HONDURAS					PAKISTÁN				
USD	250.000	Honduras (Govt of) 6.25% 19/01/2027	270.844	0,50	USD	274.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 15/04/2024	296.779	0,54
Total de Honduras			270.844	0,50	Total de Pakistán			296.779	0,54
INDONESIA					PARAGUAY				
USD	950.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	1.090.359	2,00	USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	393.869	0,72
USD	300.000	Indonesia (Govt of) 5.13% 15/01/2045	359.762	0,66	USD	200.000	Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	243.030	0,45
Total de Indonesia			1.450.121	2,66	Total de Paraguay			636.899	1,17
COSTA DE MARFIL					PERÚ				
USD	224.400	Ivory Coast (Govt of) FRN 31/12/2032	220.746	0,40	PEN	1.384.000	Peru (Govt of) 5.40% 12/08/2034	433.856	0,79
Total de Costa de Marfil			220.746	0,40	PEN	2.125.000	Peru (Govt of) 6.95% 12/08/2031	764.599	1,40
Total de Perú			1.198.455	2,19					
MÉXICO					CATAR				
MXN	145.000	Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	816.855	1,50	USD	1.450.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	1.608.470	2,96
Total de México			816.855	1,50	USD	1.082.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049	1.341.284	2,47
					USD	200.000	Qatar (Govt of) 5.10% 23/04/2048	256.042	0,47
					Total de Catar			3.205.796	5,90
MONGOLIA					RUMANÍA				
USD	500.000	Mongolia (Govt of) 5.63% 01/05/2023	506.365	0,93	EUR	400.000	Romania (Govt of) 4.63% 03/04/2049	566.495	1,04
Total de Mongolia			506.365	0,93	Total de Rumanía			566.495	1,04
NIGERIA					FEDERACIÓN RUSA				
USD	520.000	Nigeria (Govt of) 6.50% 28/11/2027	526.859	0,96	RUB	40.700.000	Russia (Govt of) 7.15% 12/11/2025	639.493	1,17
USD	600.000	Nigeria (Govt of) 7.88% 16/02/2032	633.192	1,16	USD	800.000	Russian (Govt of) - Eurobond 4.38% 21/03/2029	857.412	1,57
Total de Nigeria			1.160.051	2,12	USD	600.000	Russia (Govt of) - Eurobond 5.10% 28/03/2035	679.295	1,24
					Total de Federación Rusa			2.176.200	3,98
OMÁN									
USD	400.000	Oman (Govt of) 6.00% 01/08/2029	398.767	0,73					
USD	450.000	Oman (Govt of) 6.50% 08/03/2047	416.715	0,76					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo					Valor de mercado USD	% del valor liquidativo		
Valor nominal		Inversión				Valor nominal		Inversión					
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos (continuación)						Bonos (continuación)							
ARABIA SAUDÍ						EMIRATOS ÁRABES UNIDOS							
USD	350.000	Saudi (Govt) 4.50%	26/10/2046	391.191	0,72	USD	200.000	Abu Dhabi (Govt of) 3.13%	03/05/2026	209.930	0,38		
Total de Arabia Saudí				391.191	0,72	USD	300.000	Abu Dhabi (Govt of) 4.13%	11/10/2047	352.088	0,64		
SENEGAL						Total de Emiratos Árabes Unidos							
USD	359.000	Senegal (Govt of) 6.25%	23/05/2033	362.154	0,66	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					32.105.744	58,80	
Total de Senegal				362.154	0,66	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa						46.733.051	85,58
SUDÁFRICA						Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente							
USD	820.000	Eskom Holdings Limited 5.75%	26/01/2021	829.225	1,52	Bonos							
ZAR	10.580.000	South Africa (Govt of) 10.50%	21/12/2026	778.829	1,43	VENEZUELA							
Total de Sudáfrica				1.608.054	2,95	USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00%	15/11/2026	174.972	0,32		
SRI LANKA						Total de Venezuela							
USD	400.000	Sri Lanka (Govt of) 6.75%	18/04/2028	383.201	0,70	Total de bonos					174.972	0,32	
USD	440.000	Sri Lanka (Govt of) 6.85%	03/11/2025	442.083	0,81	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda							
USD	250.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55%	28/03/2030	247.342	0,45	EGIPTO							
USD	200.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55%	28/03/2030	197.920	0,36	EGP	19.725.000	Egypt (Govt of) 0.00%	05/11/2019	1.191.857	2,18		
Total de Sri Lanka				1.270.546	2,32	Total de Egipto					1.191.857	2,18	
TURQUÍA						NIGERIA							
USD	400.000	Turkey (Govt of) 5.13%	17/02/2028	370.470	0,68	NGN	350.000.000	Nigeria (Govt of) 0.00%	16/01/2020	899.229	1,65		
USD	1.075.000	Turkey (Govt of) 6.00%	25/03/2027	1.057.448	1,94	Total de Nigeria					899.229	1,65	
USD	450.000	Turkey (Govt of) 6.88%	17/03/2036	449.619	0,82	VENEZUELA							
Total de Turquía				1.877.537	3,44	USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25%	13/10/2024	205.451	0,38		
UCRANIA						Total de Venezuela							
USD	300.000	Ukraine (Govt of) 7.38%	25/09/2032	303.607	0,56	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					2.296.537	4,21	
USD	1.000.000	Ukraine (Govt of) 7.75%	01/09/2026	1.048.958	1,92	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente						2.471.509	4,53
Total de Ucrania				1.352.565	2,48								

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
Bonos				
CHILE				
USD	200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.00% 30/09/2029	199.639	0,37
USD	500.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.70% 30/01/2050	502.242	0,92
Total de Chile			701.881	1,29
Total de bonos			701.881	1,29
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			701.881	1,29
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
Fondos				
IRLANDA				
3.267.161	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.267.161	5,98	
Total de Irlanda			3.267.161	5,98
Total de fondos			3.267.161	5,98
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			3.267.161	5,98
Valor total de las inversiones			53.173.602	97,38
(Coste total: USD 53.673.786)				

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
BERMUDAS					KAZAJISTÁN				
USD	1.000.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	1.022.029	0,78	USD	1.550.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	1.693.601	1,31
USD	1.600.000	Li & Fung Limited 4.38% 04/10/2024	1.600.794	1,22			Total de Kazajistán	1.693.601	1,31
		Total de Bermudas	2.622.823	2,00	LUXEMBURGO				
					USD	820.000	Gaz Capital for Gazprom OAO 6.51% 07/03/2022	893.124	0,68
					USD	1.615.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	1.689.528	1,29
					USD	360.000	Millicom International Cellular SA 6.63% 15/10/2026	393.853	0,30
							Total de Luxemburgo	2.976.505	2,27
ISLAS CAIMÁN					MALASIA				
USD	1.040.000	Chn Aoyuan Group Limited 6.35% 11/01/2020	1.043.650	0,80	USD	1.400.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	1.348.345	1,03
USD	170.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	170.319	0,13			Total de Malasia	1.348.345	1,03
USD	2.400.000	Lenovo Perpetual Securities Limited Perp FRN	2.361.000	1,81	MAURICIO				
USD	400.000	MGM China Holdings Limited 5.38% 15/05/2024	413.997	0,32	USD	1.280.000	Azure Power Solar Energy Pvt Limited 5.65% 24/12/2024	1.283.200	0,98
USD	2.000.000	Vale Overseas Limited 6.25% 10/08/2026	2.314.168	1,77	USD	1.300.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	1.301.569	1,00
		Total de Islas Caimán	6.303.134	4,83	USD	1.000.000	HTA Group Limited 9.13% 08/03/2022	1.045.325	0,80
REPÚBLICA DOMINICANA							Total de Mauricio	3.630.094	2,78
USD	800.000	Dominican (Gov) 7.50% 06/05/2021	837.168	0,64	MÉXICO				
		Total de República Dominicana	837.168	0,64	USD	950.000	Elementia SAB de CV 5.50% 15/01/2025	928.582	0,71
HUNGRÍA					USD	1.300.000	Grupo Posadas SAB de CV 7.88% 30/06/2022	1.303.088	1,00
USD	630.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 4.00% 30/01/2020	633.276	0,48	USD	1.514.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	1.577.913	1,21
		Total de Hungría	633.276	0,48	USD	5.771.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	6.214.645	4,77
INDIA							Total de México	10.024.228	7,69
USD	1.000.000	JSW Steel Limited 4.75% 12/11/2019	1.001.481	0,77	MARRUECOS				
USD	650.000	JSW Steel Limited 5.25% 13/04/2022	657.489	0,50	USD	1.540.000	OCP SA 5.63% 25/04/2024	1.685.338	1,29
USD	1.500.000	ReNew Power Limited 6.45% 27/09/2022	1.517.045	1,15			Total de Marruecos	1.685.338	1,29
		Total de India	3.176.015	2,42					
INDONESIA									
USD	2.250.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.23% 15/11/2021	2.364.472	1,81					
USD	500.000	Pertamina Persero PT 4.30% 20/05/2023	524.948	0,40					
		Total de Indonesia	2.889.420	2,21					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
PAÍSES BAJOS					REINO UNIDO (continuación)				
USD	620.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	655.925	0,50	USD	811.500	Ukreximbank Via Biz Finance plc 9.63% 27/04/2022	849.358	0,65
USD	1.900.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	2.016.400	1,54	USD	1.047.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	966.952	0,74
Total de Países Bajos			2.672.325	2,04	Total del Reino Unido			3.245.199	2,49
PERÚ					ESTADOS UNIDOS				
USD	500.000	Inretail Pharma SA 5.38% 02/05/2023	525.313	0,40	USD	1.020.000	Cemex Finance LLC 6.00% 01/04/2024	1.050.218	0,80
Total de Perú			525.313	0,40	Total de Estados Unidos			1.050.218	0,80
ARABIA SAUDÍ					ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)				
USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	354.253	0,27	USD	580.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	613.689	0,47
USD	300.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	303.645	0,23	USD	860.000	Sinopec Group Overseas Development 3.90% 17/05/2022	890.149	0,68
Total de Arabia Saudí			657.898	0,50	USD	600.000	Sinopec Group Overseas Development 4.13% 12/09/2025	649.000	0,50
SINGAPUR					USD	820.000	Sinopec Group Overseas Development 2013 4.38% 17/10/2023	879.817	0,67
USD	800.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	595.755	0,46	USD	700.000	Studio City Company Limited 7.25% 30/11/2021	714.077	0,54
USD	1.500.000	Golden Legacy Pte Limited 6.88% 27/03/2024	1.525.304	1,17	USD	250.000	Studio City Finance Limited 7.25% 11/02/2024	263.722	0,20
USD	445.000	Medco Oak Tree Pte Limited 7.38% 14/05/2026	450.275	0,34	Total de Islas Vírgenes (Británicas)			4.010.454	3,06
Total de Singapur			2.571.334	1,97	Total de bonos			53.614.037	41,03
SUDÁFRICA					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
USD	640.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	660.727	0,51	ANGOLA				
Total de Sudáfrica			660.727	0,51	USD	300.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	337.579	0,26
TURQUÍA					Total de Angola			337.579	0,26
USD	380.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	400.622	0,31	ARGENTINA				
Total de Turquía			400.622	0,31	USD	2.900.000	Argentina (Govt of) 5.88% 11/01/2028	1.191.562	0,91
REINO UNIDO					Total de Argentina			1.191.562	0,91
USD	1.025.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	1.015.783	0,78					
USD	400.000	Ukraine Railways Via Shortline plc 9.88% 15/09/2021	413.106	0,32					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo					Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal		Inversión				Valor nominal		Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)						Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)						Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					
BARÉIN						EGIPTO					
USD	500.000	Bahrain (Govt of)	7.00% 26/01/2026	562.212	0,43	USD	1.493.000	Egypt (Govt of)	6.20% 01/03/2024	1.562.433	1,20
USD	383.000	CBB International Sukuk Company 6 Spc	5.25% 20/03/2025	403.189	0,31			Total de Egipto		1.562.433	1,20
Total de Bahrein				965.401	0,74						
BIELORRUSIA						EL SALVADOR					
USD	1.202.000	Belarus (Govt of)	6.88% 28/02/2023	1.287.642	0,99	USD	1.381.000	El Salvador (Govt of)	7.38% 01/12/2019	1.389.126	1,06
Total de Bielorrusia				1.287.642	0,99			Total de El Salvador		1.389.126	1,06
BRASIL						GEORGIA					
USD	2.500.000	Brazil (Govt of)	4.25% 07/01/2025	2.639.105	2,02	USD	1.200.000	Georgia (Govt of)	6.88% 12/04/2021	1.271.613	0,97
BRL	4.790	Brazil (Govt of)	10.00% 01/01/2025	1.318.295	1,01			Total de Georgia		1.271.613	0,97
Total de Brasil				3.957.400	3,03						
CROACIA						GUATEMALA					
USD	600.000	Croatia (Govt of)	6.38% 24/03/2021	633.911	0,49	USD	745.000	Guatemala (Govt of)	5.75% 06/06/2022	793.932	0,61
USD	600.000	Croatia (Govt of)	6.63% 14/07/2020	619.807	0,47			Total de Guatemala		793.932	0,61
USD	200.000	Croatia (Govt of)	6.75% 05/11/2019	200.603	0,15						
Total de Croacia				1.454.321	1,11						
REPÚBLICA DOMINICANA						HONDURAS					
USD	1.500.000	Dominican Republic (Govt of)	5.88% 18/04/2024	1.585.125	1,21	USD	1.700.000	Honduras (Govt of)	7.50% 15/03/2024	1.889.687	1,45
DOP	20.000.000	Dominican Republic (Govt of)	8.90% 15/02/2023	384.349	0,29			Total de Honduras		1.889.687	1,45
DOP	35.900.000	Dominican Republic (Govt of)	11.50% 10/05/2024	760.615	0,58						
DOP	52.000.000	Dominican Republic (Govt of)	16.95% 04/02/2022	1.173.507	0,90						
Total de República Dominicana				3.903.596	2,98						
ECUADOR						INDONESIA					
USD	1.650.000	Ecuador (Govt of)	8.75% 02/06/2023	1.757.773	1,35	USD	700.000	Indonesia (Govt of)	3.38% 15/04/2023	719.419	0,55
Total de Ecuador				1.757.773	1,35	USD	2.500.000	Indonesia (Govt of)	5.38% 17/10/2023	2.766.509	2,12
								Total de Indonesia		3.485.928	2,67
						COSTA DE MARFIL					
						USD	606.000	Ivory Coast (Govt of)	5.38% 23/07/2024	622.590	0,48
								Total de Costa de Marfil		622.590	0,48
						MONGOLIA					
						USD	2.800.000	Mongolia (Govt of)	5.63% 01/05/2023	2.835.641	2,17
								Total de Mongolia		2.835.641	2,17

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
NIGERIA					SENEGAL				
USD	560.000	Nigeria (Govt of) 6.75% 28/01/2021	580.425	0,44	USD	293.000	Senegal (Govt of) 6.25% 30/07/2024	318.560	0,24
USD	900.000	Nigeria (Govt of) 7.63% 21/11/2025	989.631	0,76	USD	1.000.000	Senegal (Govt of) 8.75% 13/05/2021	1.086.999	0,83
Total de Nigeria			1.570.056	1,20	Total de Senegal			1.405.559	1,07
OMÁN					SERBIA				
USD	2.690.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	2.591.089	1,98	USD	476.000	Serbia (Govt of) 4.88% 25/02/2020	480.246	0,37
Total de Omán			2.591.089	1,98	Total de Serbia			480.246	0,37
PAKISTÁN					SUDÁFRICA				
USD	420.000	Pakistan (Govt of) 6.75% 03/12/2019	422.238	0,32	USD	2.500.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	2.528.125	1,93
USD	200.000	Third Pakistan International Sukuk Company Limited 5.50% 13/10/2021	201.139	0,15	ZAR	15.500.000	South Africa (Govt of) 10.50% 21/12/2026	1.141.006	0,87
Total de Pakistán			623.377	0,47	Total de Sudáfrica			3.669.131	2,80
PARAGUAY					SRI LANKA				
USD	1.250.000	Paraguay (Govt of) 4.63% 25/01/2023	1.314.088	1,01	USD	1.599.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	1.592.555	1,22
Total de Paraguay			1.314.088	1,01	USD	1.600.000	Sri Lanka (Govt of) 5.88% 25/07/2022	1.609.040	1,23
CATAR					USD	661.000	Sri Lanka (Govt of) 6.35% 28/06/2024	662.771	0,51
USD	1.600.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	1.683.951	1,29	USD	400.000	Sri Lanka (Govt of) 6.83% 18/07/2026	396.343	0,30
USD	1.500.000	Qatar (Govt of) 3.38% 14/03/2024	1.570.350	1,20	Total de Sri Lanka			4.260.709	3,26
USD	1.218.000	Qatar (Govt of) 3.88% 23/04/2023	1.289.422	0,99					
Total de Catar			4.543.723	3,48	TURQUÍA				
FEDERACIÓN RUSA					USD	2.500.000	Turkey (Govt of) 3.25% 23/03/2023	2.335.456	1,79
USD	1.200.000	Russia (Govt of) 4.75% 27/05/2026	1.312.131	1,00	USD	2.250.000	Turkey (Govt of) 6.35% 10/08/2024	2.297.982	1,76
Total de la Federación Rusa			1.312.131	1,00	Total de Turquía			4.633.438	3,55
ARABIA SAUDÍ					UCRANIA				
USD	250.000	Saudi (Govt of) 2.88% 04/03/2023	254.501	0,19	USD	2.500.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2023	2.639.875	2,02
Total de Arabia Saudí			254.501	0,19	USD	650.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2024	688.632	0,53
					USD	300.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	314.687	0,24
					Total de Ucrania			3.643.194	2,79

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD		% del valor liquidativo			Valor de mercado USD		% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
EMIRATOS ÁRABES UNIDOS					VENEZUELA				
USD	600.000	Abu Dhabi (Govt of) 2.50% 11/10/2022			USD	1.245.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024		
USD	1.250.000	Abu Dhabi (Govt of) 3.13% 03/05/2026						127.654	0,10
Total de los Emiratos Árabes Unidos					Total de Venezuela				0,10
			1.918.966	1,46				127.654	0,10
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
			60.926.432	46,61				5.364.258	4,11
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
			114.540.469	87,64				5.364.258	4,11
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					Valor total de las inversiones				
								119.904.727	91,75
					(Coste total: USD 119.063.127)				
Bonos									
VENEZUELA									
USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024							
USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026							
Total de Venezuela			330.797	0,25					
Total de bonos			330.797	0,25					
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda									
EGIPTO									
EGP	49.300.000	Egypt (Govt of) 0.00% 05/11/2019	2.978.887	2,29					
Total de Egipto			2.978.887	2,29					
NIGERIA									
NGN	750.000.000	Nigeria (Govt of) 0.00% 16/01/2020	1.926.920	1,47					
Total de Nigeria			1.926.920	1,47					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
CANADÁ					PAÍSES BAJOS				
USD	266.000	Bausch Health Cos Inc. 7.00% 15/01/2028	287.253	0,14	USD	323.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	339.956	0,16
		Total de Canadá	287.253	0,14	USD	198.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	215.173	0,10
					USD	955.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	999.169	0,48
							Total de Países Bajos	1.554.298	0,74
FRANCIA					SUPRANACIONAL				
USD	598.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	606.223	0,29	USD	382.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.13% 15/08/2026	385.807	0,18
USD	1.529.000	Altice France SA 7.38% 01/05/2026	1.640.143	0,77	USD	455.000	Ardagh Packaging Finance plc 5.25% 15/08/2027	461.885	0,22
USD	550.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	608.974	0,29	USD	1.259.000	Starfruit Finco BV 8.00% 01/10/2026	1.261.360	0,60
USD	328.000	SPCM SA 4.88% 15/09/2025	335.339	0,16			Total de supranacional	2.109.052	1,00
		Total de Francia	3.190.679	1,51					
ALEMANIA					REINO UNIDO				
USD	125.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	123.181	0,06	USD	78.000	International Game Technology plc 6.25% 15/01/2027	86.681	0,04
		Total de Alemania	123.181	0,06	USD	597.000	Virgin Media Finance plc 5.75% 15/01/2025	617.927	0,29
IRLANDA					USD	1.025.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/01/2026	1.053.828	0,50
USD	830.000	Ardagh Packaging Finance 4.63% 15/05/2023	850.750	0,41	USD	355.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/08/2026	373.611	0,18
		Total de Irlanda	850.750	0,41			Total del Reino Unido	2.132.047	1,01
ITALIA					ESTADOS UNIDOS				
USD	154.000	Telecom Italia SpA 5.30% 30/05/2024	166.370	0,08	USD	102.000	Acadia Healthcare Company 5.63% 15/02/2023	104.428	0,05
		Total de Italia	166.370	0,08	USD	651.000	Acadia Healthcare Company 6.50% 01/03/2024	680.232	0,32
LUXEMBURGO					USD	344.000	AES Corp. 4.88% 15/05/2023	350.257	0,17
USD	121.000	Altice Luxembourg SA 7.75% 15/05/2022	123.647	0,06	USD	462.000	AES Corp. 5.13% 01/09/2027	491.951	0,23
USD	570.000	Altice Luxembourg SA 10.50% 15/05/2027	643.815	0,31	USD	177.000	AES Corp. 6.00% 15/05/2026	188.129	0,09
USD	701.000	Ineos Group Holdings 5.63% 01/08/2024	722.390	0,34	USD	457.000	Ally Financial Inc. 8.00% 01/11/2031	633.183	0,30
USD	201.000	Telecom Italia Capital SA 6.00% 30/09/2034	213.758	0,10	USD	140.000	APX Group Inc. 8.75% 01/12/2020	138.180	0,07
		Total de Luxemburgo	1.703.610	0,81	USD	88.000	Avis Budget Car Rental LLC 5.50% 01/04/2023	89.908	0,04
					USD	181.000	B&G Foods Inc. 4.63% 01/06/2021	181.149	0,09
					USD	511.000	B&G Foods Inc. 5.25% 01/04/2025	523.719	0,25

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD	% del valor liquidativo			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo		
Valor nominal	Inversión			Valor nominal	Inversión				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)					
USD	385.000	B&G Foods Inc. 5.25% 15/09/2027	394.384	0,19	USD	144.000	Freeport-Mcmoran Copper & Gold Inc. 3.55% 01/03/2022	144.961	0,07
USD	930.000	Berry Global Inc. 5.13% 15/07/2023	955.869	0,46	USD	697.000	Freeport-Mcmoran Inc. 4.55% 14/11/2024	715.157	0,34
USD	185.000	Berry Global Inc. 5.13% 15/07/2023	190.146	0,09	USD	1.128.000	Freeport-McMoran Inc. 5.45% 15/03/2043	1.018.449	0,49
USD	809.000	Boyd Gaming Corp. 6.88% 15/05/2023	840.073	0,40	USD	313.000	Freeport-McMoran Inc. 5.25% 01/09/2029	312.739	0,15
USD	399.000	Broadcom Cayman Finance 3.88% 15/01/2027	400.858	0,19	USD	320.000	Frontier Communications Corp. 7.13% 15/01/2023	142.000	0,07
USD	256.000	Callon Petroleum Company 6.13% 01/10/2024	252.000	0,12	USD	197.000	Frontier Communications Corp. 11.00% 15/09/2025	91.482	0,04
USD	502.000	Calpine Corp. 5.25% 01/06/2026	520.407	0,25	USD	330.000	Group 1 Automotive Inc. 5.00% 01/06/2022	334.592	0,16
USD	150.000	Calpine Corp. 5.50% 01/02/2024	152.320	0,07	USD	1.110.000	HCA Inc. 5.63% 01/09/2028	1.242.922	0,59
USD	152.000	Calpine Corp. 5.75% 15/01/2025	156.275	0,07	USD	327.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	368.522	0,18
USD	647.000	Carrizo Oil & Gas Inc. 6.25% 15/04/2023	614.650	0,29	USD	547.000	Icahn Enterprises LP 6.25% 01/02/2022	562.038	0,27
USD	539.000	Cedar Fair LP 5.38% 01/06/2024	555.881	0,26	USD	956.000	Iron Mountain Inc. 5.75% 15/08/2024	967.950	0,46
USD	676.000	Centene Corp. 4.75% 15/01/2025	696.027	0,33	USD	402.000	Istar Inc. 6.00% 01/04/2022	414.150	0,20
USD	1.081.000	CenturyLink Inc. 7.50% 01/04/2024	1.208.936	0,58	USD	240.000	L Brands Inc. 6.88% 01/11/2035	208.604	0,10
USD	825.000	CenturyLink Inc. 5.80% 15/03/2022	871.865	0,42	USD	207.000	L Brands Inc. 7.50% 15/06/2029	206.094	0,10
USD	139.000	CF Industries Inc. 5.15% 15/03/2034	145.255	0,07	USD	78.000	Lennar Corp 4.75% 29/11/2027	83.909	0,04
USD	78.000	CF Industries Inc. 5.38% 15/03/2044	78.694	0,04	USD	802.000	Lennar Corp. 4.50% 30/04/2024	845.407	0,39
USD	713.000	Chemours Company 7.00% 15/05/2025	675.865	0,32	USD	119.000	Lennar Corp. 4.75% 01/04/2021	121.939	0,06
USD	682.000	Chesapeake Energy Corp. 7.50% 01/10/2026	468.602	0,22	USD	581.000	Match Group Inc. 6.38% 01/06/2024	611.925	0,29
USD	760.000	Cinemark USA Inc. 5.13% 15/12/2022	773.112	0,37	USD	375.000	Meritage Homes Corp. 5.13% 06/06/2027	396.973	0,19
USD	1.105.000	Clearway Energy Operating LLC 5.38% 15/08/2024	1.137.804	0,54	USD	187.000	Meritage Homes Corp. 6.00% 01/06/2025	206.842	0,10
USD	550.000	Community Health Systems (CHS) 6.25% 31/03/2023	549.313	0,26	USD	207.000	MGM Growth Properties 4.50% 01/09/2026	219.938	0,10
USD	205.000	DaVita Inc. 5.13% 15/07/2024	209.074	0,10	USD	158.000	MGM Growth Properties 5.63% 01/05/2024	173.657	0,08
USD	639.000	DCP Midstream Operating LP 5.13% 15/05/2029	650.849	0,31	USD	511.000	MGM Resorts International 6.00% 15/03/2023	564.172	0,27
USD	389.000	DCP Midstream Operating LP 5.60% 01/04/2044	367.119	0,17	USD	450.000	Navient Corp. 5.50% 25/01/2023	465.834	0,22
USD	214.000	Diamond Offshore 7.88% 15/08/2025	168.124	0,08	USD	772.000	Navient Corp. 6.50% 15/06/2022	824.987	0,39
USD	302.000	Dish DBS Corp. 5.88% 15/11/2024	299.310	0,14	USD	200.000	Navient Corp. 6.63% 26/07/2021	211.486	0,10
USD	185.000	Encompass Health Corp 4.50% 01/02/2028	187.141	0,09	USD	111.000	Navient Corp. 6.75% 15/06/2026	113.739	0,05
USD	185.000	Encompass Health Corp 4.75% 01/02/2030	187.040	0,09	USD	289.000	Navient Corp. 7.25% 25/01/2022	312.840	0,15
					USD	6.000	Navient Corp. 7.25% 25/09/2023	6.536	0,00
					USD	609.000	NCR Corp. 5.00% 15/07/2022	616.613	0,29
					USD	740.000	NCR Corp. 6.38% 15/12/2023	760.368	0,36
					USD	1.145.000	Netflix Inc. 4.88% 15/04/2028	1.165.753	0,55
					USD	768.000	Netflix Inc. 5.75% 01/03/2024	840.192	0,40
					USD	352.000	Netflix Inc. 5.88% 15/11/2028	383.647	0,18

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ESTADOS UNIDOS (continuación)					ESTADOS UNIDOS (continuación)				
USD	80.000	NRG Energy Inc. 5.75% 15/01/2028	86.233	0,04	USD	463.000	T-Mobile USA Inc. 4.75% 01/02/2028	485.620	0,23
USD	764.000	NRG Energy Inc. 6.63% 15/01/2027	828.633	0,40	USD	998.000	T-Mobile USA Inc. 5.38% 15/04/2027	1.076.065	0,51
USD	322.000	NRG Energy Inc. 7.25% 15/05/2026	353.677	0,17	USD	1.147.000	T-Mobile USA Inc. 6.50% 15/01/2026	1.233.960	0,59
USD	249.000	NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	269.493	0,13	USD	112.000	Transdigm Inc. 6.00% 15/07/2022	113.958	0,05
USD	892.000	Outfront Media Cap LLC 5.88% 15/03/2025	920.814	0,44	USD	260.000	Transdigm Inc. 6.38% 15/06/2026	273.975	0,13
USD	238.000	Penske Automotive Group Inc. 5.38% 01/12/2024	245.140	0,12	USD	1.664.000	Transdigm Inc. 6.50% 15/05/2025	1.734.803	0,83
USD	257.000	QEP Resources Inc. 5.63% 01/03/2026	221.984	0,11	USD	567.000	Transdigm Inc. 7.50% 15/03/2027	616.967	0,29
USD	289.000	Rowan Companies Inc. 4.75% 15/01/2024	172.135	0,08	USD	208.000	TRI Pointe Group Inc. 5.88% 15/06/2024	221.813	0,11
USD	543.000	Scientific Games Corp. 10.00% 01/12/2022	565.399	0,27	USD	710.000	United Rentals North America Inc. 5.88% 15/09/2026	758.404	0,36
USD	265.000	Scotts Miracle-Gro Company 6.00% 15/10/2023	273.824	0,13	USD	191.000	United Rentals North America Inc. 4.63% 15/10/2025	195.680	0,09
USD	156.000	SM Energy Company 5.63% 01/06/2025	134.519	0,06	USD	327.000	United Rentals North America Inc. 4.88% 15/01/2028	340.284	0,16
USD	132.000	SM Energy Company 6.63% 15/01/2027	114.015	0,05	USD	506.000	United Rentals North America Inc. 5.50% 15/05/2027	537.309	0,26
USD	742.000	SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	651.723	0,31	USD	230.000	United Rentals North America Inc. 6.50% 15/12/2026	250.219	0,12
USD	694.000	Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	725.917	0,35	USD	180.000	Vistra Energy Corp. 7.63% 01/11/2024	188.145	0,09
USD	794.000	Springleaf Finance Corp 6.13% 15/03/2024	858.132	0,42	USD	169.000	Welbilt Inc. 9.50% 15/02/2024	181.833	0,09
USD	397.000	Springleaf Finance Corp. 5.63% 15/03/2023	425.882	0,20	USD	439.000	Wellcare Health Plans 5.25% 01/04/2025	458.889	0,22
USD	189.000	Springleaf Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	208.879	0,10	USD	751.000	WPX Energy Inc. 5.25% 15/09/2024	771.435	0,37
USD	194.000	Springleaf Finance Corp. 7.13% 15/03/2026	215.069	0,10	USD	356.000	WPX Energy Inc. 5.25% 15/10/2027	359.115	0,17
USD	480.000	Sprint Corp. 7.13% 15/06/2024	518.248	0,25	USD	445.000	WPX Energy Inc. 5.75% 01/06/2026	457.483	0,22
USD	1.356.000	Sprint Corp. 7.63% 15/02/2025	1.493.871	0,71	USD	320.000	Zayo Group LLC 6.00% 01/04/2023	329.416	0,16
USD	603.000	Sprint Corp. 7.63% 01/03/2026	667.737	0,32	USD	881.000	Zayo Group LLC 6.38% 15/05/2025	908.531	0,44
USD	710.000	Tenet Healthcare Corp 4.63% 15/07/2024	731.107	0,35	Total de Estados Unidos			56.730.218	27,03
USD	372.000	Tenet Healthcare Corp 5.13% 01/05/2025	377.599	0,18	Total de bonos			68.847.458	32,79
USD	616.000	Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/06/2023	646.911	0,31	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			68.847.458	32,79
USD	204.000	Tenet Healthcare Corp. 8.13% 01/04/2022	221.146	0,11					
USD	546.000	T-Mobile USA Inc. 4.50% 01/02/2026	563.681	0,27					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
BERMUDAS					ISLAS CAIMÁN				
USD	448.000	Viking Cruises Limited 5.88% 15/09/2027	474.701	0,22	USD	319.000	Global Aircraft Leasing Company Limited 6.50% 15/09/2024	323.267	0,15
Total de Bermudas			474.701	0,22	USD	209.150	Transocean Guardian Limited 5.88% 15/01/2024	212.016	0,10
CANADÁ					IRLANDA				
USD	233.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 3.88% 15/01/2028	234.602	0,11	USD	97.000	Transocean Inc. 7.50% 15/01/2026	86.269	0,04
USD	490.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 4.63% 15/01/2022	489.792	0,23	USD	165.540	Transocean Pontus Limited 6.13% 01/08/2025	168.230	0,08
USD	476.000	Bausch Health Americas Inc. 8.50% 31/01/2027	534.953	0,25	USD	185.000	Transocean Poseidon Limited 6.88% 01/02/2027	193.890	0,09
USD	525.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	550.318	0,26	USD	273.000	Transocean Sentry Limited 5.38% 15/05/2023	273.341	0,13
USD	370.000	Bausch Health Cos Inc. P.P. 144A 5.88% 15/05/2023	376.117	0,18	Total de Islas Caimán			1.257.013	0,59
USD	838.000	Bausch Health Cos Inc. P.P. 144A 6.13% 15/04/2025	870.995	0,42	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
USD	147.000	Bausch Health Cos Inc. 7.00% 15/03/2024	154.675	0,07	USD	1.481.000	Ardagh Packaging Finance 6.00% 15/02/2025	1.549.459	0,74
USD	124.000	Bombardier Inc. 6.00% 15/10/2022	123.820	0,06	USD	444.000	James Hardie International Finance DAC 4.75% 15/01/2025	459.259	0,22
USD	185.000	Bombardier Inc. 7.50% 01/12/2024	185.879	0,09	Total de Irlanda			2.008.718	0,96
USD	209.000	Bombardier Inc. 7.50% 15/03/2025	209.392	0,10	LUXEMBURGO				
USD	415.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	414.056	0,20	USD	1.009.000	Camelot Finance SA 7.88% 15/10/2024	1.049.360	0,51
USD	151.000	GFL Environmental Inc. 5.38% 01/03/2023	153.235	0,07	USD	352.000	Fage International 5.63% 15/08/2026	316.686	0,15
USD	110.000	GFL Environmental Inc. 7.00% 01/06/2026	116.182	0,06	USD	650.000	Intelsat Jackson Holdings SA 8.50% 15/10/2024	655.889	0,31
USD	476.000	GFL Environmental Inc. 8.50% 01/05/2027	528.360	0,24	USD	425.000	Nielsen Company Luxembourg Sarl 5.50% 01/10/2021	427.162	0,20
USD	211.000	Hudbay Minerals Inc. 7.25% 15/01/2023	218.507	0,10	Total de Luxemburgo			2.449.097	1,17
USD	1.074.000	Hudbay Minerals Inc. 7.63% 15/01/2025	1.093.479	0,52	PAÍSES BAJOS				
USD	150.000	Meg Energy Corp. 6.50% 15/01/2025	155.353	0,07	USD	555.000	Alcoa Nederland Holding BV 6.75% 30/09/2024	585.203	0,28
USD	166.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	173.196	0,08	USD	560.000	Atotech Alpha 2 BV 8.75% 01/06/2023	557.900	0,27
USD	797.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc. 5.38% 15/01/2025	833.582	0,39	USD	552.000	Atotech Alpha 3 BV 6.25% 01/02/2025	556.485	0,27
USD	747.000	Rockpoint Gas Storage 7.00% 31/03/2023	751.980	0,36	USD	953.000	Constellium NV 5.88% 15/02/2026	996.163	0,47
Total de Canadá			8.168.473	3,86					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
PAÍSES BAJOS (continuación)					ESTADOS UNIDOS (continuación)				
USD	623.000	Constellium NV 6.63% 01/03/2025	651.185	0,31	USD	410.000	Ascend Learning LLC 6.88% 01/08/2025	427.553	0,20
USD	497.000	Stars Group Holdings BV 7.00% 15/07/2026	528.699	0,25	USD	398.000	Ascend Learning LLC 6.88% 01/08/2025	415.039	0,20
USD	1.034.000	Ziggo BV 5.50% 15/01/2027	1.081.823	0,52	USD	318.000	Avantor Inc. 6.00% 01/10/2024	341.408	0,16
Total de Países Bajos			4.957.458	2,37	USD	807.000	Avantor Inc. 9.00% 01/10/2025	908.379	0,44
SUPRANACIONAL					USD	744.000	Avis Budget Car Rental LLC 5.25% 15/03/2025	767.952	0,37
USD	192.000	Panther BF Aggregator 2 LP 6.25% 15/05/2026	202.320	0,10	USD	439.000	Axalta Coating System Limited 4.88% 15/08/2024	455.417	0,22
USD	403.000	Panther BF Aggregator 2 LP 8.50% 15/05/2027	408.716	0,19	USD	650.000	Bausch Health Americas Inc. 9.25% 01/04/2026	738.904	0,35
Total de supranacional			611.036	0,29	USD	116.000	Bausch Health Cos Inc. P.P. 144A 5.50% 01/03/2023	117.450	0,06
REINO UNIDO					USD	626.000	Beacon Roofing Supply 6.38% 01/10/2023	649.260	0,31
USD	404.000	International Game Tech 6.25% 15/02/2022	426.833	0,20	USD	1.122.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.88% 01/11/2025	1.102.366	0,52
USD	705.000	International Game Tech P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	782.937	0,38	USD	157.000	Berry Global Inc. 4.88% 15/07/2026	162.838	0,08
Total del Reino Unido			1.209.770	0,58	USD	130.000	Berry Global Inc. 5.63% 15/07/2027	134.799	0,06
ESTADOS UNIDOS					USD	756.000	Big River Steel 7.25% 01/09/2025	802.154	0,38
USD	145.000	Acrisure LLC 8.13% 15/02/2024	156.328	0,07	USD	249.000	Boyd Gaming Corp 6.00% 15/08/2026	263.744	0,13
USD	214.000	Albertsons Cos Inc. 5.75% 15/03/2025	221.445	0,11	USD	202.000	BWX Technologies Inc. 5.38% 15/07/2026	213.255	0,10
USD	487.000	Albertsons Cos Inc. 5.88% 15/02/2028	516.373	0,25	USD	413.000	Caesars Resort Collection LLC 5.25% 15/10/2025	421.877	0,20
USD	261.000	Albertsons Cos Inc. 7.50% 15/03/2026	292.433	0,14	USD	301.000	Calfrac Holdings LP 8.50% 15/06/2026	136.955	0,07
USD	316.000	Alliant Holdings Intermediate LLC 8.25% 01/08/2023	323.059	0,15	USD	199.000	California Resources Corp. 8.00% 15/12/2022	99.376	0,05
USD	634.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 5.75% 15/12/2023	655.199	0,31	USD	1.273.000	Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	1.246.235	0,60
USD	571.000	American Builders & Contractors Supply Company Inc. 5.88% 15/05/2026	601.238	0,28	USD	415.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 4.88% 15/01/2026	427.018	0,20
USD	310.000	Antero Midstream Partners LP 5.75% 01/03/2027	259.081	0,12	USD	343.000	CCO Holdings LCC 5.13% 01/05/2027	358.649	0,17
USD	834.000	Apergy Corp 6.38% 01/05/2026	831.915	0,39	USD	439.000	Cco Holdings LLC P.P. 144A 5.88% 01/05/2027	465.936	0,22
USD	434.000	APX Group Inc. 7.63% 01/09/2023	387.044	0,18	USD	998.000	CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	1.013.594	0,48
USD	766.000	APX Group Inc. 7.88% 01/12/2022	766.958	0,37	USD	606.000	CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	627.968	0,30
USD	380.000	APX Group Inc. 8.50% 01/11/2024	385.225	0,18	USD	885.000	CCO Holdings LLC 5.38% 01/05/2025	919.294	0,44
USD	372.000	Aruba Investments Inc. P.P. 144A 8.75% 15/02/2023	370.528	0,18	USD	93.000	CCO Holdings LLC 5.38% 01/06/2029	99.103	0,05

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ESTADOS UNIDOS (continuación)					ESTADOS UNIDOS (continuación)				
USD	681.000	CCO Holdings LLC 5.50% 01/05/2026	714.131	0,34	USD	435.000	CSC Holdings LLC 5.38% 15/07/2023	447.229	0,21
USD	63.000	CCO Holdings LLC 5.75% 15/02/2026	66.670	0,03	USD	917.000	CSC Holdings LLC 5.50% 15/05/2026	966.243	0,46
USD	384.000	CCO Holdings LLC 5.88% 01/04/2024	401.223	0,19	USD	733.000	CSC Holdings LLC 5.75% 15/01/2030	766.534	0,36
USD	750.000	CDK Global Inc. 4.88% 01/06/2027	782.899	0,37	USD	932.000	CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	1.035.895	0,49
USD	1.037.000	Centene Corp. 5.38% 01/06/2026	1.087.553	0,52	USD	730.000	CSC Holdings LLC P.P. 144A 6.63% 15/10/2025	782.232	0,37
USD	831.000	Centennial Resource Production LLC 5.38% 15/01/2026	797.760	0,38	USD	692.000	CSC Holdings LLC 7.50% 01/04/2028	782.202	0,38
USD	291.000	Centennial Resource Production LLC 6.88% 01/04/2027	291.000	0,14	USD	459.000	CSC Holdings LLC P.P. 144A 10.88% 15/10/2025	520.724	0,25
USD	780.000	Change Healthcare Holdings LLC 5.75% 01/03/2025	793.232	0,38	USD	1.182.000	Cyrusone LP 5.38% 15/03/2027	1.264.739	0,60
USD	195.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.13% 30/06/2027	213.647	0,10	USD	83.000	Darling Ingredients Inc. 5.25% 15/04/2027	87.381	0,04
USD	295.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7.00% 30/06/2024	339.250	0,16	USD	264.000	DCP Midstream Operating LP 5.38% 15/07/2025	283.767	0,14
USD	772.000	Cheniere Energy Partners LP 4.50% 01/10/2029	792.265	0,38	USD	508.000	Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	507.153	0,24
USD	614.000	Cheniere Energy Partners LP 5.63% 01/10/2026	652.352	0,31	USD	534.000	Diamond Sports Group LLC 5.38% 15/08/2026	554.441	0,26
USD	158.000	Clean Harbors Inc. 4.88% 15/07/2027	165.280	0,08	USD	317.000	Diamond Sports Group LLC 6.63% 15/08/2027	329.022	0,16
USD	110.000	Clean Harbors Inc. 5.13% 15/07/2029	117.130	0,06	USD	1.567.000	DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	1.599.710	0,77
USD	612.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	640.137	0,30	USD	412.000	Eagle Holding Company II LLC 7.75% 15/05/2022	416.106	0,20
USD	1.067.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 9.25% 15/02/2024	1.174.270	0,56	USD	634.000	Eldorado Resorts Inc. 6.00% 01/04/2025	669.952	0,32
USD	411.000	Clearway Energy Operating LLC 5.75% 15/10/2025	434.522	0,21	USD	336.000	Eldorado Resorts Inc. 6.00% 15/09/2026	369.236	0,18
USD	540.000	Colfax Corp 6.00% 15/02/2024	572.184	0,28	USD	1.239.000	Element Solutions Inc. 5.88% 01/12/2025	1.299.834	0,61
USD	161.000	Colfax Corp 6.38% 15/02/2026	173.628	0,08	USD	204.000	Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	217.008	0,10
USD	320.000	CommScope Inc. 5.50% 01/03/2024	329.100	0,16	USD	215.000	Energizer Holdings Inc. 6.38% 15/07/2026	230.139	0,11
USD	381.000	CommScope Inc. 6.00% 01/03/2026	394.468	0,19	USD	417.000	Energizer Holdings Inc. 7.75% 15/01/2027	463.130	0,22
USD	13.000	CommScope Inc. 8.25% 01/03/2027	12.712	0,01	USD	61.000	Flex Acquisition Company Inc. 6.88% 15/01/2025	55.905	0,03
USD	555.000	CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	502.969	0,24	USD	505.000	Flex Acquisition Company Inc. 7.88% 15/07/2026	467.756	0,22
USD	632.000	Core & Main 6.13% 15/08/2025	633.479	0,30	USD	211.000	frontdoor Inc. 6.75% 15/08/2026	231.577	0,11
USD	1.377.000	Crownrock LP 5.63% 15/10/2025	1.389.324	0,66	USD	350.000	Frontier Communications 8.50% 01/04/2026	350.337	0,17
USD	691.000	CSC Holdings LLC 5.13% 15/12/2021	691.570	0,33	USD	319.000	Gartner Inc. 5.13% 01/04/2025	334.306	0,16

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ESTADOS UNIDOS (continuación)					ESTADOS UNIDOS (continuación)				
USD	977.000	Gates Global LLC P.P. 144A 6.00% 15/07/2022	978.396	0,47	USD	368.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 5.75% 01/02/2027	412.461	0,20
USD	474.000	Genesys Telecommunications Laboratories Inc. 10.00% 30/11/2024	512.809	0,24	USD	411.000	MPH Acquisition Holdings LLC 7.13% 01/06/2024	380.946	0,18
USD	640.000	H&E Equipment Services 5.63% 01/09/2025	660.075	0,32	USD	840.000	Nabors Industries Inc. 5.75% 01/02/2025	627.900	0,30
USD	472.000	Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	491.765	0,23	USD	299.000	NCR Corp 5.75% 01/09/2027	310.026	0,15
USD	416.000	Hertz Corp. 5.50% 15/10/2024	417.061	0,20	USD	377.000	NCR Corp 6.13% 01/09/2029	398.492	0,19
USD	347.000	Hertz Corp. 7.13% 01/08/2026	362.181	0,17	USD	579.000	Netflix Inc. 5.38% 15/11/2029	604.991	0,29
USD	857.000	Hertz Corp. 7.63% 01/06/2022	893.422	0,42	USD	30.000	Netflix Inc. 6.38% 15/05/2029	33.242	0,02
USD	845.000	Holly Energy Partners 6.00% 01/08/2024	882.732	0,42	USD	501.000	NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	516.798	0,25
USD	132.000	Horizon Pharma USA Inc. 5.50% 01/08/2027	138.179	0,07	USD	299.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.25% 15/07/2024	308.718	0,15
USD	683.000	HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	703.917	0,33	USD	815.000	NFP Corp. 6.88% 15/07/2025	812.775	0,39
USD	115.000	IAA Inc. 5.50% 15/06/2027	122.246	0,06	USD	832.000	Novelis Corp. 5.88% 30/09/2026	874.224	0,41
USD	173.000	iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	180.397	0,09	USD	551.000	Novelis Corp. 6.25% 15/08/2024	578.722	0,28
USD	252.910	iHeartCommunications Inc. 6.38% 01/05/2026	274.100	0,13	USD	328.000	NRG Energy Inc. 5.25% 15/06/2029	353.108	0,17
USD	1.230.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	1.329.986	0,64	USD	144.000	Outfront Media Capital LLC 5.00% 15/08/2027	151.380	0,07
USD	234.000	Indigo Natural Resources 6.88% 15/02/2026	211.478	0,10	USD	289.000	Owens-Brockway 5.88% 15/08/2023	308.141	0,15
USD	579.000	Informatica LLC P.P. 144A 7.13% 15/07/2023	590.520	0,28	USD	418.000	Par Pharmaceutical Inc. 7.50% 01/04/2027	382.701	0,18
USD	432.000	IQVIA Inc. 5.00% 15/05/2027	453.924	0,22	USD	1.224.000	Parsley Energy LLC 5.25% 15/08/2025	1.242.770	0,60
USD	604.000	IRB Holding 6.75% 15/02/2026	609.422	0,29	USD	823.000	Parsley Energy LLC 5.63% 15/10/2027	851.919	0,41
USD	545.000	Iron Mountain Inc. 4.88% 15/09/2029	554.415	0,26	USD	419.000	Pdc Energy Inc. 6.13% 15/09/2024	418.738	0,20
USD	551.000	Jagged Peak Energy LLC 5.88% 01/05/2026	553.066	0,26	USD	335.000	Performance Food Group Inc. 5.50% 15/10/2027	353.006	0,17
USD	967.000	Jaguar Holding Company 6.38% 01/08/2023	1.002.356	0,48	USD	644.000	PetSmart Inc. 5.88% 01/06/2025	643.598	0,31
USD	689.000	Kar Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	714.838	0,34	USD	447.000	PetSmart Inc. P.P. 144A 7.13% 15/03/2023	419.995	0,20
USD	50.000	Lennar Corp 5.25% 01/06/2026	54.307	0,03	USD	559.000	Post Holdings Inc. 5.00% 15/08/2026	580.896	0,27
USD	116.000	Marriott Ownership Resorts Inc. 4.75% 15/01/2028	117.305	0,06	USD	258.000	Post Holdings Inc. 5.50% 15/12/2029	269.650	0,13
USD	879.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	882.318	0,42	USD	11.000	Post Holdings Inc. 5.63% 15/01/2028	11.660	0,01
USD	425.000	Mattel Inc. 6.75% 31/12/2025	443.993	0,21	USD	2.025.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	2.149.399	1,01
USD	654.000	Mauser Packaging Solutions Holding Company 5.50% 15/04/2024	673.996	0,32	USD	621.000	PQ Corp. 5.75% 15/12/2022	642.541	0,31
USD	214.000	MGM Growth Properties 4.50% 15/01/2028	222.293	0,11	USD	819.000	PQ Corp. 6.75% 15/11/2022	848.689	0,40
					USD	220.000	Prestige Brands Inc. 5.38% 15/12/2021	221.801	0,11

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ESTADOS UNIDOS (continuación)					ESTADOS UNIDOS (continuación)				
USD	766.000	Prestige Brands Inc. 6.38% 01/03/2024	800.158	0,37	USD	110.000	Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/09/2024	109.588	0,05
USD	289.000	Qorvo Inc. 4.38% 15/10/2029	291.168	0,14	USD	542.000	Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/01/2028	530.428	0,25
USD	1.217.000	Qualitytech LP 4.75% 15/11/2025	1.255.538	0,60	USD	918.000	Tallgrass Energy Partners LP 4.75% 01/10/2023	920.869	0,44
USD	1.032.000	Quicken Loans Inc. P.P. 144A 5.75% 01/05/2025	1.067.593	0,52	USD	981.000	Targa Resources 5.38% 01/02/2027	1.017.788	0,48
USD	314.000	Radiate Holdco 6.88% 15/02/2023	323.682	0,15	USD	302.000	Targa Resources Partners LP 4.25% 15/11/2023	304.831	0,15
USD	245.000	Radiate Holdco LLC 6.63% 15/02/2025	247.285	0,12	USD	1.431.000	Targa Resources Partners LP 5.00% 15/01/2028	1.448.314	0,69
USD	737.000	Refinitiv US Holdings Inc. 6.25% 15/05/2026	792.275	0,38	USD	113.000	Targa Resources Partners LP 6.50% 15/07/2027	123.576	0,06
USD	744.000	Refinitiv US Holdings Inc. 8.25% 15/11/2026	821.654	0,40	USD	645.000	Taylor Morrison 5.88% 15/04/2023	690.150	0,33
USD	318.000	Resideo Funding Inc. 6.13% 01/11/2026	336.381	0,16	USD	313.000	Taylor Morrison Communities Inc. 5.75% 15/01/2028	340.805	0,16
USD	1.370.000	Reynolds Group Issuer Inc. 5.13% 15/07/2023	1.407.512	0,67	USD	463.000	Tegna Inc. 5.00% 15/09/2029	469.366	0,22
USD	774.000	Reynolds Group Issuer Inc. 7.00% 15/07/2024	803.798	0,38	USD	677.000	Tempo Acquisition LLC 6.75% 01/06/2025	697.936	0,33
USD	275.000	Ryman Hospitality Properties Inc. 4.75% 15/10/2027	282.654	0,13	USD	715.000	Tenet Healthcare Corp 4.88% 01/01/2026	736.301	0,35
USD	750.000	SBA Communications 4.88% 15/07/2022	760.950	0,36	USD	1.227.000	Tenet Healthcare Corp 5.13% 01/11/2027	1.267.919	0,59
USD	722.000	SBA Communications 4.88% 01/09/2024	749.704	0,36	USD	815.000	Tenet Healthcare Corp 6.25% 01/02/2027	849.699	0,40
USD	798.000	Scientific Games International Inc. 5.00% 15/10/2025	824.872	0,40	USD	610.000	Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	637.069	0,30
USD	577.000	Scientific Games International Inc. 8.25% 15/03/2026	615.226	0,29	USD	1.468.000	TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	1.580.008	0,75
USD	180.000	Scripps Escrow Inc. 5.88% 15/07/2027	183.038	0,09	USD	805.000	Transmontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	778.838	0,37
USD	510.000	Select Medical Corp 6.25% 15/08/2026	535.819	0,26	USD	616.000	Uber Technologies Inc. 7.50% 15/09/2027	615.230	0,29
USD	146.000	Sensata Technologies Inc. 4.38% 15/02/2030	146.091	0,07	USD	53.000	USI Inc. 6.88% 01/05/2025	53.794	0,03
USD	204.000	SESI LLC 7.75% 15/09/2024	117.051	0,06	USD	536.000	Valvoline Inc. 5.50% 15/07/2024	558.445	0,27
USD	239.000	Sirius XM Radio Inc. 4.63% 15/07/2024	248.213	0,12	USD	511.000	Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	545.426	0,26
USD	1.061.000	Sirius XM Radio Inc. P.P. 144A 5.38% 15/04/2025	1.101.930	0,52	USD	196.000	ViaSat Inc. 5.63% 15/04/2027	207.045	0,10
USD	149.000	Sophia LP P.P. 144A 9.00% 30/09/2023	153.108	0,07	USD	236.000	Vistra Operations Co LLC 5.50% 01/09/2026	247.756	0,12
USD	849.000	Sotera Health Holdings LLC 6.50% 15/05/2023	870.756	0,41	USD	348.000	Vistra Operations Company LLC 5.00% 31/07/2027	359.153	0,17
USD	235.000	Stevens Holding Company Inc. 6.13% 01/10/2026	251.132	0,12	USD	725.000	Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	765.274	0,36
USD	297.000	Sunoco LP 4.88% 15/01/2023	305.353	0,15	USD	547.000	WellCare Health Plans Inc. 5.38% 15/08/2026	584.155	0,28
USD	652.000	Sunoco LP 5.50% 15/02/2026	679.308	0,32	USD	131.000	West Street Merger Sub Inc. 6.38% 01/09/2025	121.563	0,06

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)			
Bonos (continuación)				Renta variable			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS			
USD	666.000 Wynn Las Vegas LLC 5.50% 01/03/2025	700.133	0,33	2.118.000	CB T-Mobile USA Inc.	0	0,00
USD	185.000 Wynn Resorts Finance LLC 5.13% 01/10/2029	194.180	0,09	998.000	CB T-Mobile USA Inc.	0	0,00
USD	303.000 XPO Logistics Inc. P.P. 144A 6.50% 15/06/2022	308.871	0,15	546.000	T-Mobile	0	0,00
USD	238.000 Yum! Brands Inc. 4.75% 15/01/2030	245.884	0,12	683.000	T-Mobile	0	0,00
USD	417.000 Zayo Group LLC 5.75% 15/01/2027	427.321	0,20	Total de Estados Unidos		0	0,00
USD	292.000 Zekelman Industries 9.88% 15/06/2023	308.425	0,15	Total de renta variable		0	0,00
Total de Estados Unidos		113.737.835	54,21	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		2.093.663	1,01
Total de bonos		135.140.539	64,38	Valor total de las inversiones		206.081.660	98,18
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				(Coste total: USD 201.050.761)			
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
Bonos							
ESTADOS UNIDOS							
USD	95.000 AMN Healthcare Inc. 4.63% 01/10/2027	95.772	0,05				
USD	312.000 Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	315.120	0,15				
USD	111.000 MTS Systems Corp 5.75% 15/08/2027	115.671	0,06				
USD	533.000 Pattern Energy Group Inc. 5.88% 01/02/2024	549.847	0,26				
USD	789.000 Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	768.289	0,37				
USD	102.000 Trimas Corp. 4.88% 15/10/2025	104.040	0,05				
USD	140.000 Vhf Parent LLC 6.75% 15/06/2022	144.924	0,07				
Total de Estados Unidos		2.093.663	1,01				
Total de bonos		2.093.663	1,01				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
BAHAMAS					INDIA (continuación)				
USD	500.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	516.728	1,21	USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	524.822	1,23
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 4.25% 12/03/2029	214.264	0,50	USD	500.000	ReNew Power Limited 6.45% 27/09/2022	505.682	1,18
Total de Bahamas			730.992	1,71	Total de India			2.260.582	5,28
BERMUDAS					INDONESIA				
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	204.406	0,48	USD	900.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.53% 15/11/2028	1.101.735	2,57
USD	500.000	Li & Fung Limited 4.38% 04/10/2024	500.248	1,17	USD	500.000	Perusahaan Listrik Negara PT 5.45% 21/05/2028	575.928	1,34
Total de Bermudas			704.654	1,65	Total de Indonesia			1.677.663	3,91
ISLAS CAIMÁN					ISLA DE MAN				
USD	800.000	Alibaba Group Holding Limited 3.40% 06/12/2027	830.029	1,94	USD	500.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	521.877	1,22
USD	400.000	Baidu Inc. 4.88% 14/11/2028	450.417	1,05	Total de Isla de Man			521.877	1,22
USD	200.000	China Overseas Finance Cayman VII Limited 4.25% 26/04/2023	209.977	0,49	MALASIA				
USD	600.000	Lenovo Perpetual Securities Limited Perp FRN	590.250	1,38	USD	500.000	Malayan Banking Bhd FRN 29/10/2026	508.780	1,19
USD	500.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	490.516	1,14	USD	500.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	481.552	1,12
USD	600.000	MGM China Holdings Limited 5.38% 15/05/2024	620.995	1,45	USD	650.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	740.312	1,74
USD	600.000	Sands China Limited 5.40% 08/08/2028	677.613	1,58	Total de Malasia			1.730.644	4,05
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 4.53% 11/04/2049	239.500	0,56	MAURICIO				
USD	350.000	Times China Holdings Limited 10.95% 27/11/2020	371.848	0,87	USD	220.000	Azure Power Solar Energy Pvt Limited 5.65% 24/12/2024	220.550	0,51
Total de Islas Caimán			4.481.145	10,46	Total de Mauricio			220.550	0,51
HONG KONG					PAÍSES BAJOS				
USD	500.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 3.38% 19/06/2024	504.557	1,18	USD	400.000	Greenko Dutch BV 5.25% 24/07/2024	402.000	0,94
USD	250.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 5.13% 14/03/2028	281.132	0,66	USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	254.894	0,59
Total de Hong Kong			785.689	1,84	Total de Países Bajos			656.894	1,53
INDIA					REPÚBLICA DE COREA (SUR)				
USD	800.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	831.893	1,94	USD	700.000	Shinhan Financial Group Company Limited Perp FRN	753.265	1,76
USD	200.000	Delhi International Airport Limited 6.45% 04/06/2029	212.109	0,50	Total de República de Corea (Sur)			753.265	1,76
USD	200.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	186.076	0,43					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado USD		% del valor liquidativo			Valor de mercado USD		% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)				
SINGAPUR					INDONESIA (continuación)				
USD	250.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	186.173	0,43	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	271.632	0,63
USD	200.000	Medco Oak Tree Pte Limited 7.38% 14/05/2026	202.371	0,47	IDR	5.500.000.000	Indonesia (Govt of) 7.50% 15/08/2032	382.825	0,89
Total de Singapur			388.544	0,90	IDR	5.500.000.000	Indonesia (Govt of) 7.50% 15/05/2038	380.655	0,89
TAILANDIA					USD	300.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	451.741	1,05
USD	400.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	405.358	0,95	IDR	21.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2029	1.572.579	3,67
Total de Tailandia			405.358	0,95	IDR	5.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2036	364.640	0,85
REINO UNIDO					IDR	22.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/03/2034	1.636.962	3,82
SGD	1.000.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	740.560	1,72	IDR	19.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/04/2039	1.404.641	3,28
USD	200.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	184.709	0,43	USD	300.000	Perusahaan Penerbit Sbsn Indonesia 4.35% 10/09/2024	322.744	0,75
Total del Reino Unido			925.269	2,15	Total de Indonesia			12.835.156	29,96
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					MONGOLIA				
USD	350.000	Bluestar Finance Holdings Limited Perp FRN	369.676	0,86	USD	800.000	Mongolia (Govt of) 5.63% 01/05/2023	810.183	1,89
USD	250.000	CNOOC Finance 2013 Limited 2.88% 30/09/2029	249.285	0,58	Total de Mongolia			810.183	1,89
USD	250.000	ENN Clean Energy International Investment Limited 7.50% 27/02/2021	257.813	0,60	PAKISTÁN				
USD	311.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	309.206	0,72	USD	550.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	595.769	1,39
USD	400.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	411.225	0,96	USD	250.000	Third Pakistan International Sukuk Company Limited 5.63% 05/12/2022	250.862	0,59
Total de Islas Vírgenes (Británicas)			1.597.205	3,72	Total de Pakistán			846.631	1,98
Total de bonos			17.840.331	41,64	SRI LANKA				
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda					USD	750.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	746.977	1,74
INDONESIA					USD	750.000	Sri Lanka (Govt of) 6.75% 18/04/2028	718.502	1,68
USD	500.000	Indonesia (Govt of) 3.50% 11/01/2028	518.217	1,21	USD	450.000	Sri Lanka (Govt of) 6.83% 18/07/2026	445.886	1,04
USD	750.000	Indonesia (Govt of) 4.13% 15/01/2025	799.381	1,87	USD	450.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	445.216	1,04
USD	1.750.000	Indonesia (Govt of) 4.35% 11/01/2048	1.927.626	4,51	Total de Sri Lanka			2.356.581	5,50
USD	1.500.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	1.712.159	4,00					
USD	850.000	Indonesia (Govt of) 5.35% 11/02/2049	1.089.354	2,54					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

				Valor de mercado		% del valor						Valor de mercado		% del valor	
Valor nominal		Inversión		USD		liquidativo		Valor nominal		Inversión		USD		liquidativo	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)								Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente							
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda (continuación)								Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda							
TAILANDIA								MALASIA							
THB	20.000.000	Thailand (Govt of) 1.45% 17/12/2024		657.729		1,54		MYR	3.500.000	Malaysia (Govt of) 4.37% 31/10/2028		893.177		2,08	
THB	15.000.000	Thailand (Govt of) 2.88% 17/06/2046		606.194		1,42		MYR	3.500.000	Malaysia (Govt of) 4.76% 04/08/2037		947.401		2,21	
THB	30.000.000	Thailand (Govt of) 3.30% 17/06/2038		1.263.834		2,95		Total de Malasia				1.840.578		4,29	
Total de Tailandia				2.527.757		5,91									
VIETNAM								FILIPINAS							
USD	400.000	Vietnam (Govt of) 6.75% 29/01/2020		406.143		0,95		PHP	40.000.000	Philippine (Govt of) 5.75% 12/04/2025		810.618		1,89	
								PHP	25.000.000	Philippine (Govt of) 6.75% 24/01/2039		582.606		1,36	
Total de Vietnam				406.143		0,95		PHP	20.000.000	Philippine (Govt of) 8.00% 19/07/2031		488.582		1,14	
								Total de Filipinas				1.881.806		4,39	
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda								19.782.451		46,19					
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa								37.622.782		87,83	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
											3.722.384		8,68		
											Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente				
											3.722.384		8,68		
Valor total de las inversiones								41.345.166		96,51					
(Coste total: USD 38.443.429)															

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (continuación)			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Fondos (continuación)			
INDONESIA				LUXEMBURGO			
IDR 4.650.000.000	Indonesia (Govt of) 7.00% 15/09/2030	294.043	1,21	57.160	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU*	732.985	3,02
IDR 5.200.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2029	357.183	1,47	13.514	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Fund XUP*	143.326	0,59
Total de Indonesia		651.226	2,68	1.626.586	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 8E*	2.894.674	11,91
ESTADOS UNIDOS				161.932	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond 4E*	1.719.575	7,08
USD 775.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.13% 15/04/2022	742.728	3,06	349.391	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities IE*	3.531.159	14,53
USD 80.000	United States Treasury Inflation Indexed N/B FRN 15/02/2041	114.836	0,47	69.481	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies 4E*	691.735	2,85
USD 550.000	United States Treasury Inflation Indexed N/B 2.52% 15/02/2040	793.315	3,27	4.699	Threadneedle (Lux) - European Short Term High Yield Bond XE*	472.524	1,95
Total de Estados Unidos		1.650.879	6,80	Total de Luxemburgo		10.185.978	41,93
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				REINO UNIDO			
		2.302.105	9,48	241.897	Threadneedle Investment Funds ICVC - European Select Fund**	427.967	1,76
Renta variable				62.532	Threadneedle Investment Funds ICVC - American Fund**	306.236	1,26
GUERNSEY - ISLAS DEL CANAL				515.467	Threadneedle Investment Funds ICVC - Asia Fund**	1.042.660	4,29
572.358	UK Commercial Property REIT Limited	543.447	2,24	262.666	Threadneedle Investment Funds ICVC - European Fund**	441.821	1,82
Total de Guernsey - Islas del Canal		543.447	2,24	1.437.465	Threadneedle Investment Funds ICVC - Japan Fund**	2.560.730	10,53
Total de renta variable		543.447	2,24	465.148	Threadneedle Investment Funds ICVC - UK Fund**	700.177	2,88
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				1.859.775	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Sterling Short-Dated Corp. Bond Fund**	2.348.139	9,67
		2.845.552	11,72	Total del Reino Unido		7.827.730	32,21
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				Total de fondos		18.777.005	77,28
Fondos				Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		18.777.005	77,28
IRLANDA				Valor total de las inversiones		21.622.557	89,00
7.652	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	763.297	3,14	(Coste total: EUR 20.814.826)			
Total de Irlanda		763.297	3,14	<i>* Consulte la nota 18.</i>			
				<i>** Parte vinculada del fondo.</i>			

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Renta variable (continuación)			
INDONESIA				FRANCIA			
IDR 12.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2029	898.617	1,59	2.214	EssilorLuxottica SA	319.212	0,56
	Total de Indonesia	898.617	1,59	668	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	265.558	0,47
ESTADOS UNIDOS				1.970	Pernod-Ricard SA	350.933	0,62
USD 1.000.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.13% 15/04/2022	1.044.803	1,85	Total de Francia	935.703	1,65	
USD 1.401.800	United States Treasury Inflation Indexed N/B 2.52% 15/02/2040	2.204.326	3,90	ALEMANIA			
Total de Estados Unidos	3.249.129	5,75		1.637	Adidas AG	509.787	0,90
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				Total de Alemania	509.787	0,90	
	4.147.746	7,34		HONG KONG			
Renta variable				25.400	Aia Group Limited	239.926	0,42
BERMUDAS				Total de Hong Kong	239.926	0,42	
5.565	IHS Markit Limited	372.187	0,65	INDIA			
Total de Bermudas	372.187	0,65		9.972	HDFC Bank Limited - ADR	568.903	1,01
CANADÁ				Total de India	568.903	1,01	
9.754	Suncor Energy Inc.	308.031	0,54	INDONESIA			
Total de Canadá	308.031	0,54		1.130.700	Bank Rakyat Indonesia	328.190	0,58
ISLAS CAIMÁN				Total de Indonesia	328.190	0,58	
2.373	Alibaba Group Holding Limited	396.837	0,70	IRLANDA			
8.900	Tencent Holdings Limited	374.874	0,66	10.050	CRH plc	346.116	0,61
Total de Islas Caimán	771.711	1,36		3.486	Ingersoll-Rand plc	429.510	0,76
CHINA				2.429	Medtronic Inc.	263.838	0,47
26.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	304.402	0,54	Total de Irlanda	1.039.464	1,84	
Total de China	304.402	0,54		JAPÓN			
DINAMARCA				500	Keyence Corp.	309.507	0,55
4.723	Novo-Nordisk A/S	242.854	0,43	1.200	Nintendo Company Limited	444.358	0,79
Total de Dinamarca	242.854	0,43		3.700	Rohm Company Limited	282.443	0,50
FINLANDIA				Total de Japón	1.036.308	1,84	
6.502	Upm-Kymmene Oyj	192.240	0,34	JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
Total de Finlandia	192.240	0,34		2.804	Ferguson plc	205.387	0,36
				Total de Jersey - Islas del Canal	205.387	0,36	
				PAÍSES BAJOS			
				2.122	Lyondellbasell Industries NV - A	189.855	0,34
				1.703	NXP Semiconductor NV	185.831	0,33

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
PAÍSES BAJOS (continuación)				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
18.265	RELX plc	434.690	0,77	3.029	Eog Resources Inc.	224.812	0,40
	Total de Países Bajos	810.376	1,44	950	Equinix Inc.	547.960	0,97
REPÚBLICA DE COREA (SUR)				1.671	Estee Lauder Companies Inc.	332.445	0,59
11.986	Samsung Electronics Company Limited	491.507	0,87	3.041	Facebook Inc. - A	541.541	0,96
	Total de la República de Corea (Sur)	491.507	0,87	1.989	Fidelity National Information Services Inc.	264.060	0,47
ESPAÑA				5.054	Gilead Sciences Inc.	320.323	0,57
7.738	Industria de Diseño Textil SA	239.581	0,42	9.979	Halliburton Company	188.104	0,33
	Total de España	239.581	0,42	1.189	Illumina Inc.	361.718	0,64
SUIZA				5.570	JPMorgan Chase & Company	655.533	1,15
2.070	TE Connectivity Limited	192.883	0,34	1.208	Lam Research Corp.	279.181	0,49
	Total de Suiza	192.883	0,34	2.607	Mastercard Inc. - A	707.983	1,25
REINO UNIDO				6.731	Microsoft Corp.	935.812	1,66
1.761	Aon plc	340.876	0,60	843	NextEra Energy Inc.	196.411	0,35
9.520	Diageo plc	391.011	0,69	1.429	Nvidia Corp.	248.746	0,44
2.260	Reckitt Benckiser Group plc	176.680	0,31	1.241	S&P Global Inc.	304.020	0,54
8.606	Unilever plc	518.593	0,92	6.283	Service Corp. International	300.390	0,53
	Total del Reino Unido	1.427.160	2,52	1.812	Stryker Corp.	391.936	0,70
ESTADOS UNIDOS				3.037	Transunion	246.331	0,44
7.744	Activision Blizzard Inc.	409.812	0,73	3.006	Trex Company Inc.	273.336	0,48
1.207	Adobe Inc.	333.434	0,59	1.016	Tyler Technologies Inc.	266.700	0,47
855	Alphabet Inc. - A	1.044.075	1,84	2.973	Union Pacific Corp.	481.567	0,85
110	Alphabet Inc. - C	134.090	0,24	815	UnitedHealth Group Inc.	177.116	0,31
416	Amazon.com Inc.	722.138	1,28	2.209	Vertex Pharmaceuticals Inc.	374.248	0,66
2.875	Amphenol Corp.	277.437	0,49	3.756	Visa Inc. - A	646.070	1,14
3.201	Baxter International Inc.	279.991	0,49		Total de Estados Unidos	15.289.770	27,04
1.525	Becton Dickinson & Company	385.764	0,68	Total de renta variable			
8.560	Centene Corp.	370.306	0,66			25.506.370	45,09
5.086	Charles Schwab Corp.	212.747	0,38	Instrumentos estructurados - Materias primas			
1.483	CME Group Inc.	313.417	0,55	IRLANDA			
7.428	Comcast Corp.	334.854	0,59	1.691	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	241.348	0,43
1.102	Cooper Companies Inc.	327.294	0,58		Total de Irlanda	241.348	0,43
3.203	Diamondback Energy Inc.	287.982	0,51	Total de instrumentos estructurados - Materias primas			
1.604	Ecolab Inc.	317.657	0,56			241.348	0,43
2.785	Electronic Arts Inc.	272.429	0,48	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
						29.895.464	52,86

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
ESTADOS UNIDOS			
USD 4.144.700	United States Treasury Bill 0.00% 03/10/2019	4.144.311	7,33
USD 5.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/11/2019	5.490.153	9,69
USD 2.900.000	United States Treasury Bill 0.00% 05/12/2019	2.890.533	5,11
	Total de Estados Unidos	12.524.997	22,13
	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda	12.524.997	22,13
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente	12.524.997	22,13
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
LUXEMBURGO			
88.447	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU*	1.236.503	2,19
114.491	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds AU*	2.037.717	3,60
196.894	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities IUH*	2.072.704	3,66
	Total de Luxemburgo	5.346.924	9,45
	Total de fondos	5.346.924	9,45
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	5.346.924	9,45
	Valor total de las inversiones	47.767.385	84,44

(Coste total: USD 41.970.575)

* Consulte la nota 18.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
BÉLGICA					FRANCIA (continuación)				
EUR	239.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	267.384	0,10	EUR	100.000	Crown European Holdings 2.63% 30/09/2024	117.716	0,04
EUR	600.000	Solvay SA Perp FRN	722.738	0,27	EUR	100.000	Crown European Holdings 3.38% 15/05/2025	121.219	0,05
Total de Bélgica			990.122	0,37	EUR	325.000	Crown European Holdings 4.00% 15/07/2022	387.516	0,15
CANADÁ					EUR	300.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	345.539	0,13
EUR	301.000	Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15/05/2023	332.416	0,13	EUR	330.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	391.411	0,15
EUR	195.000	Cott Corp. 5.50% 01/07/2024	221.995	0,08	EUR	300.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	327.116	0,12
Total de Canadá			554.411	0,21	EUR	100.000	Elis SA 1.63% 03/04/2028	109.138	0,04
ISLAS CAIMÁN					EUR	500.000	Elis SA 1.75% 11/04/2024	565.857	0,21
GBP	415.000	Petrobras International Finance Company 6.25% 14/12/2026	606.550	0,23	EUR	300.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	339.608	0,13
EUR	90.000	UPCB Finance IV Limited 4.00% 15/01/2027	103.855	0,04	EUR	200.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	239.531	0,09
EUR	110.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029	127.549	0,05	EUR	144.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	166.899	0,06
Total de Islas Caimán			837.954	0,32	EUR	205.000	Getlink SE 3.63% 01/10/2023	233.656	0,09
FINLANDIA					EUR	264.000	La Financiere Atalian 4.00% 15/05/2024	212.612	0,08
EUR	189.000	Nokia Oyj 2.00% 11/03/2026	217.169	0,08	EUR	190.000	La Financiere Atalian 5.13% 15/05/2025	152.421	0,06
EUR	100.000	Stora Enso Oyj 2.50% 07/06/2027	119.749	0,05	EUR	200.000	Louvre Bidco SAS 4.25% 30/09/2024	222.325	0,08
Total de Finlandia			336.918	0,13	EUR	160.000	Louvre Bidco SAS FRN 30/09/2024	177.288	0,07
FRANCIA					EUR	482.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	542.162	0,20
EUR	200.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	221.674	0,08	EUR	235.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	266.007	0,10
EUR	349.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	387.322	0,15	EUR	100.000	Orange SA Perp FRN	114.399	0,04
EUR	180.000	Altice France SA 5.63% 15/05/2024	202.565	0,08	EUR	346.000	Orange SA Perp FRN	460.435	0,17
EUR	1.182.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	1.429.758	0,54	EUR	100.000	Orano SA 3.25% 04/09/2020	111.987	0,04
EUR	800.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	808.093	0,31	EUR	200.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	235.118	0,09
EUR	200.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.05% 05/08/2026	191.497	0,07	EUR	200.000	Orano SA 3.50% 22/03/2021	227.955	0,09
EUR	200.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	208.562	0,08	EUR	460.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	471.965	0,18
EUR	400.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	408.137	0,15	EUR	160.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2025	178.560	0,07
EUR	100.000	CMA CGM SA 5.25% 15/01/2025	78.052	0,03	EUR	322.000	Rexel SA 2.75% 15/06/2026	367.425	0,14
EUR	100.000	Constantin Investissement 3 SASU 5.38% 15/04/2025	112.829	0,05	EUR	465.000	Solvay Finance SA Perp FRN	546.568	0,21
EUR	250.000	Credit Agricole SA Perp FRN	295.024	0,11	EUR	300.000	SPCM SA 2.88% 15/06/2023	330.832	0,13
					EUR	300.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	352.855	0,13
					EUR	200.000	Spie SA 2.63% 18/06/2026	227.344	0,09
					Total de Francia			12.886.977	4,88
ALEMANIA									
EUR	175.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021			EUR	510.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	571.640	0,22

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ALEMANIA (continuación)					IRLANDA (continuación)				
EUR	600.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	665.704	0,25	EUR	996.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	1.161.288	0,44
EUR	200.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	231.372	0,09	EUR	325.000	James Hardie International Finance DAC 3.63% 01/10/2026	376.050	0,14
EUR	200.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 2.88% 15/07/2022	221.386	0,08	EUR	400.000	Smurfit Kappa Acquisitions 2.38% 01/02/2024	471.757	0,17
EUR	168.000	Douglas GmbH 6.25% 15/07/2022	183.858	0,07	EUR	309.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.88% 15/01/2026	371.322	0,14
EUR	165.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	186.768	0,07	EUR	291.000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.50% 15/09/2027	318.180	0,12
EUR	210.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/09/2026	236.030	0,09	GBP	1.000.000	Virgin Media Receivables Financing Note 5.50% 15/09/2024	1.264.574	0,48
EUR	109.000	Kirk Beauty One GmbH 8.75% 15/07/2023	94.539	0,04	Total de Irlanda			5.648.349	2,13
EUR	447.000	Lanxess AG FRN 06/12/2076	535.743	0,20	ISLA DE MAN				
EUR	250.000	Platin 1426 GmbH 5.38% 15/06/2023	256.820	0,10	EUR	295.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	336.274	0,13
EUR	260.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	285.762	0,11	EUR	242.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	283.838	0,11
EUR	415.000	Safari Verwaltungs GmbH 5.38% 30/11/2022	292.661	0,11	Total de Isla de Man			620.112	0,24
EUR	719.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	744.033	0,28	ITALIA				
EUR	514.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	607.840	0,23	EUR	400.000	Enel SpA FRN 24/05/2080	472.384	0,18
EUR	126.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	131.838	0,05	EUR	79.000	Enel SpA FRN 10/01/2074	100.141	0,04
EUR	359.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	391.792	0,15	EUR	374.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	419.804	0,16
EUR	499.000	Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	557.680	0,21	EUR	216.000	Leonardo SpA 1.50% 07/06/2024	244.551	0,09
EUR	453.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	509.627	0,19	EUR	50.000	Leonardo SpA 4.88% 24/03/2025	65.956	0,02
EUR	240.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH 3.75% 15/05/2024	267.119	0,10	EUR	425.000	Lkq Italia Bondco SpA 3.88% 01/04/2024	525.208	0,20
Total de Alemania			7.166.259	2,71	EUR	697.000	Nexi Capital SpA 4.13% 01/11/2023	782.644	0,30
IRLANDA					EUR	365.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	440.174	0,17
EUR	200.000	Allied Irish Banks FRN 26/11/2025	226.925	0,09	EUR	150.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	172.218	0,07
EUR	595.000	Ardagh Packaging Finance 2.75% 15/03/2024	663.712	0,25	EUR	220.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	250.936	0,09
EUR	300.000	Ardagh Packaging Finance 6.75% 15/05/2024	344.642	0,13	EUR	450.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	541.783	0,20
EUR	200.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.13% 15/05/2023	223.058	0,08	EUR	1.111.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.337.458	0,51
EUR	200.000	Bank of Ireland Perp FRN	226.841	0,09	EUR	100.000	Telecom Italia SpA 4.50% 25/01/2021	115.440	0,04
					EUR	350.000	Telecom Italia SpA 5.25% 10/02/2022	427.546	0,16
					Total de Italia			5.896.243	2,23

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
JAPÓN					LUXEMBURGO (continuación)				
EUR	255.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	298.490	0,11	EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	139.273	0,05
EUR	640.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	777.949	0,29	EUR	216.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	250.919	0,09
EUR	100.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	121.555	0,05	EUR	125.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	134.956	0,05
EUR	130.000	Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	146.871	0,06	EUR	196.000	CPI Property Group SA Perp FRN	219.140	0,08
Total de Japón			1.344.865	0,51	EUR	208.000	CPI Property Group SA Perp FRN	237.406	0,09
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					EUR	399.000	Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	450.072	0,17
EUR	175.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	201.257	0,08	EUR	325.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 22/03/2021	378.409	0,14
EUR	454.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	529.817	0,20	EUR	430.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 15/07/2022	526.421	0,19
GBP	200.000	Cpuk Finance Limited 4.25% 28/08/2022	251.901	0,10	EUR	381.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	396.924	0,15
GBP	200.000	Cpuk Finance Limited 4.88% 28/08/2025	254.670	0,10	GBP	363.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.50% 01/11/2022	422.178	0,16
EUR	710.000	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	807.744	0,31	EUR	330.000	Gestamp Fund Lux 3.50% 15/05/2023	366.429	0,14
Total de Jersey - Islas del Canal			2.045.389	0,79	EUR	600.000	Grand City Properties SA Perp FRN	699.511	0,26
LUXEMBURGO					EUR	108.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	113.874	0,04
EUR	125.000	Altice Financing SA 5.25% 15/02/2023	140.592	0,05	EUR	600.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	734.362	0,28
USD	200.000	Altice Financing SA 6.63% 15/02/2023	205.538	0,08	EUR	345.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	395.914	0,15
USD	221.000	Altice Finco SA 8.13% 15/01/2024	228.617	0,09	EUR	597.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	666.948	0,25
EUR	244.000	Altice Finco SA 9.00% 15/06/2023	276.788	0,10	EUR	215.000	Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	240.660	0,09
EUR	300.000	Altice Luxembourg SA 6.25% 15/02/2025	342.397	0,13	EUR	350.000	Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	184.384	0,07
EUR	242.981	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/05/2022	270.647	0,10	EUR	200.000	Leonardo SpA 4.50% 19/01/2021	230.341	0,09
EUR	1.064.000	Altice Luxembourg SA 8.00% 15/05/2027	1.277.271	0,48	EUR	280.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	316.021	0,12
EUR	340.000	Aramark International Finance 3.13% 01/04/2025	383.204	0,14	EUR	100.000	LSF10 Wolverine Investments SCA FRN 15/03/2024	109.812	0,04
EUR	332.000	ARD Finance SA 6.63% 15/09/2023	375.065	0,14	EUR	300.000	LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 15/03/2024	336.818	0,13
EUR	320.000	Arena Luxembourg Finance Sarl FRN 01/11/2023	352.530	0,13	EUR	338.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	376.713	0,14
EUR	100.000	Arena Luxembourg Finance Sarl 2.88% 01/11/2024	113.814	0,04	EUR	100.000	Picard Bondco SA 5.50% 30/11/2024	106.266	0,04
EUR	200.000	BMBG Bond Finance SCA 3.00% 15/06/2021	219.529	0,08	EUR	264.000	Swissport Financing Sarl 5.25% 15/08/2024	299.031	0,10

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado		% del valor				Valor de mercado		% del valor	
Valor nominal	Inversión	USD	liquidativo	Valor nominal	Inversión	USD	liquidativo	Valor nominal	Inversión	USD	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)							
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)							
LUXEMBURGO (continuación)				PAÍSES BAJOS (continuación)							
EUR	132.000	Swissport Financing Sarl 9.00% 15/02/2025	149.105	0,06	EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	338.541	0,13		
EUR	125.000	Takko Luxembourg 2 SCA 5.38% 15/11/2023	130.049	0,05	EUR	1.200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.442.519	0,55		
EUR	432.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	701.833	0,27	EUR	700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	809.046	0,31		
EUR	200.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	235.209	0,09	EUR	400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	469.077	0,18		
EUR	293.300	Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.88% 15/07/2027	354.679	0,13	EUR	200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	253.146	0,10		
		Total de Luxemburgo	14.089.649	5,27	GBP	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	652.141	0,25		
					EUR	665.000	TenneT Holding BV Perp FRN	776.140	0,29		
					EUR	790.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.13% 15/10/2024	648.827	0,24		
					EUR	309.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	283.136	0,11		
MÉXICO					EUR	337.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	342.450	0,13		
EUR	100.000	Cemex SAB de CV 2.75% 05/12/2024	112.399	0,04	EUR	177.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	204.557	0,08		
USD	200.000	Cemex SAB De CV 7.75% 16/04/2026	217.625	0,08	EUR	154.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	175.693	0,07		
		Total de México	330.024	0,12	EUR	275.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	313.737	0,12		
PAÍSES BAJOS					EUR	300.000	UPC Holding BV 3.88% 15/06/2029	344.774	0,13		
EUR	100.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	112.876	0,04	EUR	480.000	Ziggo Bond Finance BV FRN 15/01/2025	539.753	0,20		
EUR	725.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	841.004	0,31	EUR	150.000	Ziggo BV 3.75% 15/01/2025	167.894	0,06		
EUR	257.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	288.718	0,11	EUR	335.000	Ziggo BV 4.25% 15/01/2027	395.079	0,15		
EUR	150.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/03/2024	184.204	0,07			Total de Países Bajos	14.070.203	5,32		
GBP	200.000	Intergen NV 7.50% 30/06/2021	244.502	0,09			PORTUGAL				
EUR	428.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	492.457	0,19	EUR	100.000	Energias de Portugal FRN 16/09/2075	116.749	0,04		
EUR	855.000	InterXion Holding NV 4.75% 15/06/2025	1.012.522	0,38			Total de Portugal	116.749	0,04		
GBP	240.000	Koninklijke KPN NV FRN 14/03/2073	302.603	0,11			ESPAÑA				
EUR	516.000	LKQ Euro Holdings BV 3.63% 01/04/2026	590.861	0,23	EUR	100.000	Bankia SA FRN 15/03/2027	114.715	0,04		
EUR	100.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	115.058	0,04	EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	584.868	0,21		
EUR	100.000	OI European Group BV 4.88% 31/03/2021	116.559	0,04	EUR	300.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	361.313	0,14		
EUR	600.000	Petrobras Global Finance BV 4.75% 14/01/2025	768.211	0,29	EUR	200.000	Distribuidora Internacional de Alimentacion 1.00% 28/04/2021	170.207	0,06		
EUR	100.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	114.466	0,04	EUR	807.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	906.430	0,34		
EUR	374.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	470.226	0,18	EUR	357.000	Tasty Bondco 1 SA 6.25% 15/05/2026	410.976	0,16		
EUR	225.501	Summer BidCo BV 9.00% 17/11/2025	259.426	0,10			Total de España	2.548.509	0,95		

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
SUPRANACIONAL					REINO UNIDO (continuación)				
EUR	146.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	163.660	0,06	EUR	225.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	265.461	0,10
		Total de supranacional	163.660	0,06	EUR	265.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	307.787	0,12
SUECIA					GBP	815.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.011.165	0,38
EUR	778.000	Akelius Residential AB FRN 05/10/2078	911.578	0,35	GBP	425.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	461.969	0,17
EUR	474.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	526.709	0,20	EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	93.151	0,04
EUR	115.000	Volvo Car AB 2.00% 24/01/2025	130.302	0,05	GBP	200.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	232.744	0,09
EUR	366.000	Volvo Car AB 2.13% 02/04/2024	416.518	0,16	EUR	450.000	Merlin Entertainments plc 2.75% 15/03/2022	521.968	0,19
		Total de Suecia	1.985.107	0,76	GBP	100.000	Miller Homes 5.50% 15/10/2024	126.123	0,05
SUIZA					EUR	100.000	OTE plc 0.88% 24/09/2026	108.984	0,04
EUR	200.000	UBS AG FRN 12/02/2026	231.448	0,09	EUR	200.000	OTE plc 3.50% 09/07/2020	223.722	0,08
		Total de Suiza	231.448	0,09	GBP	514.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	675.986	0,26
REINO UNIDO					USD	100.000	Royal Bank of Scotland 6.13% 15/12/2022	108.272	0,04
EUR	144.000	Algeco Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	158.382	0,06	USD	440.000	Royal Bank of Scotland Perp 8.63%	471.724	0,17
GBP	436.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	517.507	0,20	GBP	287.000	Shop Direct 7.75% 15/11/2022	313.939	0,12
GBP	250.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	329.686	0,12	GBP	414.000	Stonegate Pub Company Financing plc FRN 15/03/2022	516.319	0,19
GBP	625.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	768.605	0,29	EUR	125.000	Tesco Corporate Treasury Services plc 2.50% 01/07/2024	147.264	0,06
GBP	125.000	Boparan Finance plc 5.50% 15/07/2021	95.877	0,04	EUR	100.000	Tesco Corporate Treasury Services plc 1.38% 24/10/2023	112.564	0,04
GBP	335.000	Co-operative Group FRN 08/07/2026	469.495	0,18	GBP	121.000	Tesco Corporate Treasury Services plc 2.50% 02/05/2025	151.888	0,06
GBP	167.000	Co-operative Group 5.13% 17/05/2024	217.016	0,08	GBP	63.000	Tesco plc 6.13% 24/02/2022	86.448	0,03
GBP	200.000	Drax Finco plc 4.25% 01/05/2022	250.947	0,09	GBP	684.838	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	1.238.396	0,48
EUR	600.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	662.416	0,25	GBP	100.000	Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	130.443	0,05
EUR	115.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	126.963	0,05	EUR	357.000	Victoria plc 5.25% 15/07/2024	401.337	0,15
GBP	383.000	El Group plc 7.50% 15/03/2024	506.617	0,19	EUR	300.000	Virgin Media Finance plc 4.50% 15/01/2025	338.048	0,13
USD	703.697	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	581.430	0,22	GBP	131.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	170.324	0,06
GBP	70.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	97.790	0,04	GBP	100.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.13% 15/01/2025	127.676	0,05
GBP	200.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	251.289	0,09	GBP	481.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	637.620	0,24
GBP	100.000	Heathrow Finance plc 3.88% 01/03/2027	123.428	0,05	EUR	454.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	524.825	0,20
EUR	446.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	481.607	0,18	EUR	261.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	325.159	0,12
EUR	233.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	254.332	0,10					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado USD	% del valor liquidativo				Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
REINO UNIDO (continuación)					INDONESIA				
GBP	155.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	203.279	0,08	IDR 58.000.000.000	Indonesia (Govt of) 7.00% 15/09/2030		3.998.453	1,51
USD	431.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	466.142	0,18	IDR 54.500.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2029		4.081.218	1,54
USD	159.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	183.284	0,07	Total de Indonesia			8.079.671	3,05
GBP	200.000	William Hill plc 4.75% 01/05/2026	255.686	0,10	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			8.079.671	3,05
GBP	200.000	William Hill plc 4.88% 07/09/2023	264.596	0,10					
Total del Reino Unido			17.097.680	6,47	Renta variable				
ESTADOS UNIDOS					AUSTRALIA				
EUR	785.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	916.516	0,35	585.136	Alumina Limited		935.309	0,35
EUR	309.000	Axalta Coating System Limited 4.25% 15/08/2024	348.391	0,13	166.158	Amcor plc		1.596.930	0,60
EUR	425.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	540.181	0,20	110.052	Sydney Airport Finance Company Pty Limited		596.023	0,23
EUR	620.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 4.75% 15/12/2024	698.197	0,26	96.798	Transurban Group		959.043	0,36
EUR	573.000	Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	657.430	0,26	Total de Australia			4.087.305	1,54
EUR	259.000	Colfax Corp. 3.25% 15/05/2025	291.081	0,11	AUSTRIA				
EUR	993.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	1.124.414	0,43	42.272	Erste Group Bank AG		1.398.217	0,53
EUR	700.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	796.690	0,30	Total de Austria			1.398.217	0,53
USD	52.000	Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	56.095	0,02	BRASIL				
EUR	563.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	626.653	0,24	347.129	Ambev SA		1.604.224	0,61
EUR	1.197.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	1.340.709	0,51	272.570	Kroton Educacional SA		731.582	0,28
EUR	582.000	IQVIA Inc. 3.50% 15/10/2024	647.760	0,24	Total de Brasil			2.335.806	0,89
EUR	100.000	Iron Mountain Inc. 3.00% 15/01/2025	111.981	0,04	CANADÁ				
EUR	352.000	Kronos International 3.75% 15/09/2025	384.470	0,15	90.909	Manulife Financial Corp.		1.668.496	0,63
EUR	480.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	556.565	0,21	46.696	Suncor Energy Inc.		1.473.887	0,56
EUR	300.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	347.853	0,13	22.272	TC Energy Corp.		1.153.972	0,44
EUR	664.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	769.585	0,29	Total de Canadá			4.296.355	1,63
EUR	793.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	963.528	0,36	ISLAS CAIMÁN				
EUR	609.000	Refinitiv US Holdings Inc. 4.50% 15/05/2026	716.674	0,28	842.000	HKT Trust and Hkt Limited		1.336.135	0,50
EUR	401.000	Refinitiv US Holdings Inc. 6.88% 15/11/2026	490.489	0,19	Total de Islas Caimán			1.336.135	0,50
EUR	699.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	782.956	0,31	CHINA				
EUR	832.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	959.230	0,36	53.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited		614.547	0,23
EUR	295.000	UGI International LLC 3.25% 01/11/2025	341.129	0,13	Total de China			614.547	0,23
Total de Estados Unidos			14.468.577	5,50					
Total de bonos			103.429.205	39,10					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
CURASAO				PAÍSES BAJOS			
25.044	Schlumberger Limited	855.753	0,32	64.883	RELX plc	1.544.155	0,58
	Total de Curasao	855.753	0,32	35.694	Unilever NV	2.146.085	0,81
FINLANDIA				Total de Países Bajos		3.690.240	1,39
55.381	Sampo Oyj - A	2.202.531	0,84	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
43.525	Upm-Kymmene Oyj	1.286.870	0,49	100.384	Samsung Electronics Company Limited	4.116.424	1,55
	Total de Finlandia	3.489.401	1,33	Total de República de Corea (Sur)		4.116.424	1,55
FRANCIA				ESPAÑA			
25.473	BNP Paribas	1.240.516	0,47	54.821	Ferrovial SA	1.584.393	0,59
	Total de Francia	1.240.516	0,47	Total de España		1.584.393	0,59
ALEMANIA				SUIZA			
19.678	Axel Springer SE	1.351.536	0,51	25.113	Novartis AG - Reg	2.179.490	0,82
208.556	Deutsche Telekom AG - Reg	3.500.099	1,32	148.067	UBS Group AG	1.682.394	0,64
47.416	Evonik Industries AG	1.170.845	0,44	Total de Suiza		3.861.884	1,46
	Total de Alemania	6.022.480	2,27	TAIWÁN			
HONG KONG				113.000	Eclat Textile Company Limited	1.515.209	0,57
28.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	824.427	0,31	244.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.139.239	0,81
	Total de Hong Kong	824.427	0,31	Total de Taiwán		3.654.448	1,38
INDONESIA				REINO UNIDO			
4.940.300	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	1.500.070	0,57	37.321	Anglo American plc	860.577	0,33
	Total de Indonesia	1.500.070	0,57	318.655	BAE Systems plc	2.238.268	0,85
ISLA DE MAN				70.649	British American Tobacco plc	2.618.353	1,00
70.193	Gvc Holdings plc	643.032	0,24	455.871	BT Group plc	1.003.209	0,38
	Total de Isla de Man	643.032	0,24	122.471	Glaxosmithkline plc	2.632.968	1,00
JAPÓN				110.734	Prudential plc	2.012.748	0,76
57.000	Bridgestone Corp.	2.206.689	0,83	24.433	Reckitt Benckiser Group plc	1.910.101	0,72
341.900	Daiwa Securities Group Inc. - ADR	1.522.929	0,58	29.284	Rio Tinto plc	1.518.888	0,57
1.299	Japan Hotel REIT Investment	968.766	0,37	53.448	Royal Dutch Shell plc - A	1.570.197	0,59
6.700	Nintendo Company Limited	2.480.998	0,94	Total del Reino Unido		16.365.309	6,20
7.400	Tokyo Electron Limited	1.408.105	0,53	ESTADOS UNIDOS			
	Total de Japón	8.587.487	3,25	8.093	3M Company	1.330.489	0,50
				18.278	Altria Group Inc.	747.570	0,28
				15.270	American Electric Power Company Inc.	1.430.646	0,54
				39.088	BB&T Corp.	2.086.127	0,79
				38.512	Cisco Systems Inc.	1.902.878	0,72

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
Renta variable (continuación)				Bonos			
ESTADOS UNIDOS (continuación)				PORTUGAL			
7.322	CME Group Inc.	1.547.431	0,58	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	22.761 0,01
46.165	Coca Cola Company	2.513.222	0,95			Total de Portugal	22.761 0,01
13.914	Crown Castle International Corp.	1.934.185	0,73				
29.214	Emerson Electric Company	1.953.248	0,74	REINO UNIDO			
93.242	Enterprise Products Partners LP	2.664.857	1,01	GBP	305.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	383.995 0,14
47.054	General Motors Company	1.763.584	0,67			Total del Reino Unido	383.995 0,14
29.447	Gilead Sciences Inc.	1.866.351	0,71			Total de bonos	406.756 0,15
10.583	IBM Corp.	1.538.980	0,58	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
14.343	Johnson & Johnson	1.855.697	0,70			406.756 0,15	
22.449	Las Vegas Sands Corp.	1.296.655	0,49				
4.902	Lockheed Martin Corp.	1.912.074	0,72				
35.088	Maxim Integrated Products Inc.	2.031.946	0,77	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
16.193	Merck & Company Inc.	1.363.127	0,52	Fondos			
52.910	Nutrien Limited	2.639.151	1,00	LUXEMBURGO			
18.780	Occidental Petroleum Corp.	835.147	0,32		2.301.652	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds AUP*	13.498.956 5,10
12.467	Paychex Inc.	1.031.894	0,39		137.621	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income Fund ZUP*	1.690.462 0,64
17.558	PepsiCo Inc.	2.407.202	0,91		671.054	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities IUH*	7.064.181 2,67
84.589	Pfizer Inc.	3.039.282	1,14			Total de Luxemburgo	22.253.599 8,41
12.993	Philip Morris International Inc.	986.558	0,37			Total de fondos	22.253.599 8,41
7.733	United Parcel Service Inc.	926.568	0,35			Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	22.253.599 8,41
22.647	Valero Energy Corp.	1.930.430	0,73			Valor total de las inversiones	257.460.292 97,31
4.415	Watsco Inc.	746.930	0,28			(Coste total: USD 264.245.659)	
80.370	Wells Fargo & Company	4.053.862	1,53				
31.654	Xcel Energy Inc.	2.054.029	0,78				
	Total de Estados Unidos	52.390.120	19,80				
Total de renta variable		122.894.349	46,45				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa							
		234.403.225	88,60				
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente							
Bonos							
ESTADOS UNIDOS							
USD	59.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 5.00% 15/07/2027	61.323 0,02				
USD	323.000	Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	335.389 0,13				
	Total de Estados Unidos	396.712	0,15				
Total de bonos		396.712	0,15				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente							
		396.712	0,15				

*Consulte la nota 18.

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				SUECIA			
22.457	CSL Limited	3.539.498	0,42	262.462	Atlas Copco AB	7.122.019	0,85
	Total de Australia	3.539.498	0,42		Total de Suecia	7.122.019	0,85
FRANCIA				TAIWÁN			
42.916	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	17.060.888	2,04	1.140.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	9.994.808	1,19
129.669	Pernod-Ricard SA	23.099.065	2,76		Total de Taiwán	9.994.808	1,19
	Total de Francia	40.159.953	4,80				
ALEMANIA				REINO UNIDO			
44.039	Adidas AG	13.714.433	1,64	70.208	Aon plc	13.590.163	1,62
	Total de Alemania	13.714.433	1,64	127.437	InterContinental Hotels Group plc	7.969.811	0,95
HONG KONG				34.688	Linde plc	6.731.401	0,80
1.603.400	Aia Group Limited	15.145.543	1,81		Total del Reino Unido	28.291.375	3,37
	Total de Hong Kong	15.145.543	1,81				
INDIA				ESTADOS UNIDOS			
1.425.117	HDFC Bank Limited	24.683.806	2,95	206.521	Abbott Laboratories	17.279.612	2,07
1.102.290	Kotak Mahindra Bank Limited	25.578.456	3,06	160.736	Activision Blizzard Inc.	8.506.149	1,02
	Total de India	50.262.262	6,01	156.476	Adobe Inc.	43.226.495	5,16
INDONESIA				32.729	Alphabet Inc. - A	39.966.691	4,78
2.150.000	Bank Central Asia Tbk Pt	4.597.039	0,55	11.538	Amazon.com Inc.	20.028.930	2,39
	Total de Indonesia	4.597.039	0,55	39.120	Ansys Inc.	8.659.603	1,04
IRLANDA				131.044	Automatic Data Processing Inc.	21.153.122	2,52
110.218	Ingersoll-Rand plc	13.579.960	1,62	239.931	Baxter International Inc.	20.986.765	2,51
141.759	Medtronic Inc.	15.397.863	1,84	73.188	Becton Dickinson & Company	18.513.636	2,21
	Total de Irlanda	28.977.823	3,46	644.933	Boston Scientific Corp.	26.242.323	3,14
JAPÓN				155.878	Charles Schwab Corp.	6.520.377	0,78
33.756	Keyence Corp.	20.895.448	2,50	67.390	CME Group Inc.	14.242.203	1,70
24.100	Nintendo Company Limited	8.924.188	1,07	88.264	Electronic Arts Inc.	8.633.984	1,03
	Total de Japón	29.819.636	3,57	105.257	Estee Lauder Companies Inc.	20.940.880	2,51
PAÍSES BAJOS				240.376	Fidelity National Information Services Inc.	31.912.318	3,81
1.271.640	RELX plc	30.263.845	3,62	35.714	Lam Research Corp.	8.253.863	0,99
274.674	Unilever NV	16.514.645	1,97	168.836	Mastercard Inc. - A	45.850.793	5,48
	Total de Países Bajos	46.778.490	5,59	430.595	Microsoft Corp.	59.865.622	7,15
				107.449	S&P Global Inc.	26.322.856	3,15
				68.326	Texas Instruments Inc.	8.830.452	1,06
				93.360	Thermo Fisher Scientific Inc.	27.192.967	3,25
				232.732	Transunion	18.876.893	2,26

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
93.032	UnitedHealth Group Inc.	20.217.714	2,42
128.406	Visa Inc. - A	22.087.115	2,64
Total de Estados Unidos		544.311.363	65,07
Total de renta variable		822.714.242	98,33
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en bolsa		822.714.242	98,33
Valor total de las inversiones		822.714.242	98,33
(Coste total: USD 697.218.137)			

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BERMUDAS				ISLAS CAIMÁN (continuación)			
5.462	Credicorp Limited	1.138.499	1,19	73.032	Tencent Music Entertainment Group	932.619	0,98
	Total de Bermudas	1.138.499	1,19	116.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	1.183.766	1,25
BRASIL				Total de Islas Caimán		24.860.772	26,12
62.922	Azul SA	750.913	0,79	CHINA			
295.717	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes SA	1.463.889	1,54	20.294	Ctrip.com International Limited - ADR	594.411	0,62
221.036	Itau Unibanco Holding SA - ADR	1.858.913	1,95	2.308	Kweichow Moutai Company Limited - A	371.673	0,39
98.182	Localiza Rent a Car	1.071.531	1,12	110.500	Midea Group Company Limited - A	790.698	0,83
88.776	Lojas Americanas SA Pfd	425.402	0,45	192.929	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.216.150	2,33
40.368	Lojas Renner SA	489.118	0,51	53.460	WuXi AppTec Company Limited	584.424	0,61
64.536	Magazine Luiza SA	572.324	0,60	Total de China		4.557.356	4,78
65.328	Notre Dame Intermedica Participacoes	850.829	0,89	CHIPRE			
109.093	Petrobras Distribuidora SA	721.019	0,76	33.280	Tcs Group Holding plc - Reg	582.400	0,61
102.008	Petroleo Brasileiro SA - ADR	1.340.385	1,41	Total de Chipre		582.400	0,61
15.752	Petroleo Brasileiro SA - ADR	227.931	0,24	HONG KONG			
Total de Brasil		9.772.254	10,26	243.000	Aia Group Limited	2.295.352	2,40
CANADÁ				680.000	Cnooc Limited	1.037.428	1,09
33.455	Parex Resources Inc.	512.943	0,54	209.000	Galaxy Entertainment Group Limited	1.299.687	1,36
Total de Canadá		512.943	0,54	119.000	Techtronic Industries Company	828.056	0,87
ISLAS CAIMÁN				Total de Hong Kong		5.460.523	5,72
10.857	58.com Inc. - ADR	535.359	0,56	HUNGRÍA			
21.138	Afyra Limited	541.978	0,57	28.549	OTP Bank Nyrt	1.188.416	1,25
40.754	Alibaba Group Holding Limited	6.815.291	7,16	Total de Hungría		1.188.416	1,25
4.834	Arco Platform Limited	245.035	0,26	INDIA			
7.961	BeiGene Limited - ADR	974.904	1,02	30.094	Apollo Hospitals Enterprise Limited	592.608	0,62
1.002.000	China Resources Cement Holdings Limited	1.004.635	1,05	37.342	Asian Paints Limited	928.535	0,97
10.417	Huya Inc.	246.258	0,26	8.855	Bajaj Finance Limited	505.566	0,53
612.000	Kingdee International Software Group Company Limited	644.836	0,68	45.480	Balkrishna Industries Limited	498.173	0,52
4.538	NetEase Inc. - ADR	1.207.925	1,26	2.544	Eicher Motors Limited	637.742	0,67
7.535	New Oriental Education & Technology Group - ADR	834.577	0,88	34.866	HDFC Bank Limited - ADR	1.989.105	2,09
11.048	Pagseguro Digital Limited	511.633	0,54	105.328	HDFC Standard Life Insurance	893.479	0,94
95.000	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.240.913	1,30	107.022	Indraprastha Gas Limited	528.113	0,55
14.122	StoneCo Limited	491.163	0,52	52.420	Jubilant Foodworks Limited	1.005.547	1,05
37.237	Tal Education Group - ADR	1.274.994	1,34				
146.600	Tencent Holdings Limited	6.174.886	6,49				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
INDIA (continuación)				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
3.700	Maruti Suzuki India Limited	350.637	0,37	19.633	KB Financial Group Inc.	700.860	0,74
113.515	Reliance Industries Limited	2.134.012	2,23	2.423	Pearl Abyss Corp.	401.084	0,42
51.515	Tech Mahindra Limited	519.390	0,55	116.922	Samsung Electronics Company Limited	4.794.595	5,03
	Total de India	10.582.907	11,09	23.658	SK hynix Inc.	1.625.798	1,71
INDONESIA				Total de República de Corea (Sur)		7.522.337	7,90
6.100.400	ACE Hardware Indonesia	760.699	0,80	FEDERACIÓN RUSA			
1.097.400	Bank Central Asia Tbk Pt	2.346.414	2,46	18.161	Lukoil PJSC - ADR	1.502.641	1,58
5.307.500	Bank Rakyat Indonesia	1.540.523	1,62	59.972	Sberbank of Russia PJSC - ADR	850.103	0,89
15.061.800	Pakuwon Jati Tbk Pt	705.634	0,74	Total de Federación Rusa		2.352.744	2,47
	Total de Indonesia	5.353.270	5,62	SUDÁFRICA			
LUXEMBURGO				82.690	AVI Limited	448.665	0,47
26.581	Ternium SA - ADR	510.089	0,54	7.079	Capitec Bank Holdings Limited	601.073	0,63
	Total de Luxemburgo	510.089	0,54	15.695	Naspers Limited	2.375.644	2,49
MÉXICO				Total de Sudáfrica		3.425.382	3,59
182.052	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	978.026	1,03	TAIWÁN			
	Total de México	978.026	1,03	35.000	Asmedia Technology Inc.	547.155	0,57
PAÍSES BAJOS				91.882	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	4.270.675	4,48
15.695	Prosus NV	1.152.405	1,21	Total de Taiwán		4.817.830	5,05
39.551	Yandex NV	1.384.681	1,45	TAILANDIA			
	Total de Países Bajos	2.537.086	2,66	1.121.000	Muangthai Capital plc	2.089.176	2,19
PANAMÁ				210.700	Tisco Financial	706.127	0,74
7.899	Copa Holdings SA - A	780.026	0,82	Total de Tailandia		2.795.303	2,93
	Total de Panamá	780.026	0,82	ESTADOS UNIDOS			
FILIPINAS				799	Mercadolibre Inc.	440.433	0,46
2.100.300	Ayala Land Inc.	2.003.872	2,10	Total de Estados Unidos		440.433	0,46
	Total de Filipinas	2.003.872	2,10	ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)			
POLONIA				35.935	Mail.Ru Group Limited - GDR	753.198	0,80
14.058	Dino Polska SA	550.516	0,58	Total de Islas Vírgenes (Británicas)		753.198	0,80
5.315	Kruk SA	200.713	0,21	Total de renta variable		93.676.895	98,32
	Total de Polonia	751.229	0,79				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable de garantías			
CHINA			
342	Kweichow Moutai Company Limited - Wts 14/07/2020 Str.0,01	55.075	0,06
	Total de China	55.075	0,06
PAÍSES BAJOS			
2.261	JPMorgan - Jiangsu Yanghe Brewery Joint Stock Company - Wts 23/06/2020 Str.0.01	32.928	0,03
21.501	Midea Group Company Limited - Wts 20/04/2020 Str.0.01	153.853	0,16
	Total de Países Bajos	186.781	0,19
	Total de renta variable de garantías	241.856	0,25
	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	93.918.751	98,57
	Valor total de las inversiones	93.918.751	98,57
(Coste total: USD 90.581.025)			

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				FRANCIA			
2.669.822	Alumina Limited	4.267.568	0,75	119.666	BNP Paribas	5.827.643	1,03
733.674	Amcors plc	7.051.277	1,24		Total de Francia	5.827.643	1,03
510.972	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	2.767.339	0,49				
447.630	Transurban Group	4.434.971	0,78				
	Total de Australia	18.521.155	3,26				
AUSTRIA				ALEMANIA			
189.498	Erste Group Bank AG	6.267.962	1,11	91.671	Axel Springer SE	6.296.203	1,11
	Total de Austria	6.267.962	1,11	959.800	Deutsche Telekom AG - Reg	16.107.881	2,85
				220.828	Evonik Industries AG	5.452.912	0,96
					Total de Alemania	27.856.996	4,92
BRASIL				HONG KONG			
1.608.223	Ambev SA	7.432.250	1,31	132.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	3.875.686	0,68
1.237.853	Kroton Educacional SA	3.322.417	0,59		Total de Hong Kong	3.875.686	0,68
	Total de Brasil	10.754.667	1,90				
CANADÁ				INDONESIA			
422.092	Manulife Financial Corp.	7.746.855	1,37	22.542.600	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	6.844.824	1,21
218.989	Suncor Energy Inc.	6.912.047	1,22		Total de Indonesia	6.844.824	1,21
103.082	TC Energy Corp.	5.340.956	0,94				
	Total de Canadá	19.999.858	3,53				
ISLAS CAIMÁN				ISLA DE MAN			
3.873.445	HKT Trust and Hkt Limited	6.146.610	1,08	363.937	Gvc Holdings plc	3.333.997	0,59
	Total de las Islas Caimán	6.146.610	1,08		Total de la Isla de Man	3.333.997	0,59
CHINA				JAPÓN			
247.792	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.846.354	0,50	260.181	Bridgestone Corp.	10.072.606	1,78
	Total de China	2.846.354	0,50	1.532.014	Daiwa Securities Group Inc. - ADR	6.824.069	1,21
				5.159	Japan Hotel REIT Investment	3.847.469	0,68
				30.777	Nintendo Company Limited	11.396.669	2,01
				34.428	Tokyo Electron Limited	6.551.113	1,16
					Total de Japón	38.691.926	6,84
CURASAO				PAÍSES BAJOS			
112.444	Schlumberger Limited	3.842.211	0,68	300.250	RELX plc	7.145.670	1,26
	Total de Curasao	3.842.211	0,68	165.111	Unilever NV	9.927.221	1,75
FINLANDIA					Total de los Países Bajos	17.072.891	3,01
259.728	Sampo Oyj - A	10.329.511	1,82				
201.276	Upm-Kymmene Oyj	5.950.971	1,05				
	Total de Finlandia	16.280.482	2,87				
				REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
				466.081	Samsung Electronics Company Limited	19.112.481	3,38
					Total de la República de Corea (Sur)	19.112.481	3,38

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
ESPAÑA				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
251.478	Ferrovial SA	7.268.017	1,28	67.373	Johnson & Johnson	8.716.719	1,54
	Total de España	7.268.017	1,28	105.272	Las Vegas Sands Corp.	6.080.511	1,07
				22.671	Lockheed Martin Corp.	8.843.050	1,56
SUIZA				160.960	Maxim Integrated Products Inc.	9.321.194	1,64
108.515	Novartis AG - Reg	9.417.727	1,66	74.699	Merck & Company Inc.	6.288.162	1,11
695.610	UBS Group AG	7.903.786	1,39	236.557	Nutrien Limited	11.799.464	2,08
	Total de Suiza	17.321.513	3,05	85.608	Occidental Petroleum Corp.	3.806.988	0,67
				57.622	Paychex Inc.	4.769.373	0,84
TAIWÁN				79.998	PepsiCo Inc.	10.967.726	1,94
501.000	Eclat Textile Company Limited	6.717.873	1,19	386.399	Pfizer Inc.	13.883.315	2,44
1.101.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	9.652.881	1,70	60.018	Philip Morris International Inc.	4.557.167	0,80
	Total de Taiwán	16.370.754	2,89	35.759	United Parcel Service Inc.	4.284.643	0,76
				104.722	Valero Energy Corp.	8.926.503	1,57
				20.090	Watsco Inc.	3.398.826	0,60
				366.708	Wells Fargo & Company	18.496.751	3,26
				146.467	Xcel Energy Inc.	9.504.244	1,67
				Total de Estados Unidos	240.523.991	42,42	
REINO UNIDO				Total de renta variable	564.140.120	99,54	
170.283	Anglo American plc	3.926.521	0,69	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	564.140.120	99,54	
1.495.260	BAE Systems plc	10.502.871	1,85				
317.032	British American Tobacco plc	11.749.657	2,08	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
2.123.166	BT Group plc	4.672.327	0,82	Fondos			
568.636	Glaxosmithkline plc	12.224.938	2,16	IRLANDA			
514.941	Prudential plc	9.359.786	1,65	8.069.367	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	8.069.367	1,42
112.861	Reckitt Benckiser Group plc	8.823.147	1,56	Total de Irlanda	8.069.367	1,42	
133.622	Rio Tinto plc	6.930.640	1,23	Total de fondos	8.069.367	1,42	
244.748	Royal Dutch Shell plc - A	7.190.215	1,27	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	8.069.367	1,42	
	Total del Reino Unido	75.380.102	13,31	Valor total de las inversiones	572.209.487	100,96	
				(Coste total: USD 556.093.410)			
ESTADOS UNIDOS							
37.070	3M Company	6.094.308	1,08				
84.488	Altria Group Inc.	3.455.559	0,61				
71.729	American Electric Power Company Inc.	6.720.290	1,19				
175.227	BB&T Corp.	9.351.865	1,65				
177.223	Cisco Systems Inc.	8.756.588	1,54				
33.586	CME Group Inc.	7.098.065	1,26				
213.464	Coca Cola Company	11.620.980	2,05				
63.480	Crown Castle International Corp.	8.824.355	1,56				
131.600	Emerson Electric Company	8.798.776	1,55				
426.824	Enterprise Products Partners LP	12.198.630	2,15				
214.708	General Motors Company	8.047.256	1,42				
138.341	Gilead Sciences Inc.	8.768.053	1,55				
49.131	IBM Corp.	7.144.630	1,26				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BERMUDAS				INDIA			
98.657	IHS Markit Limited	6.598.180	1,42	560.920	HDFC Bank Limited	9.715.441	2,09
	Total de Bermudas	6.598.180	1,42		Total de India	9.715.441	2,09
CANADÁ				INDONESIA			
198.258	Suncor Energy Inc.	6.260.987	1,35	20.545.800	Bank Rakyat Indonesia	5.963.501	1,29
	Total de Canadá	6.260.987	1,35		Total de Indonesia	5.963.501	1,29
ISLAS CAIMÁN				IRLANDA			
55.512	Alibaba Group Holding Limited	9.283.272	2,00	179.407	CRH plc	6.178.673	1,33
143.700	Tencent Holdings Limited	6.052.736	1,31	63.068	Ingersoll-Rand plc	7.770.608	1,68
	Total de las Islas Caimán	15.336.008	3,31	43.403	Medtronic Inc.	4.714.434	1,02
					Total de Irlanda	18.663.715	4,03
CHINA				JAPÓN			
484.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	5.559.644	1,20	8.500	Keyence Corp.	5.261.622	1,13
	Total de China	5.559.644	1,20	15.800	Nintendo Company Limited	5.850.712	1,26
				67.700	Rohm Company Limited	5.167.937	1,11
DINAMARCA					Total de Japón	16.280.271	3,50
88.433	Novo-Nordisk A/S	4.547.184	0,98		JERSEY - ISLAS DEL CANAL		
	Total de Dinamarca	4.547.184	0,98	61.419	Ferguson plc	4.498.814	0,97
FINLANDIA					Total de Jersey - Islas del Canal	4.498.814	0,97
115.263	Upm-Kymmene Oyj	3.407.892	0,73		PAÍSES BAJOS		
	Total de Finlandia	3.407.892	0,73	37.622	Lyondellbasell Industries NV - A	3.366.040	0,73
FRANCIA				30.193	NXP Semiconductor NV	3.294.660	0,71
39.519	EssilorLuxottica SA	5.697.808	1,23	324.083	RELX plc	7.712.873	1,67
12.212	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	4.854.776	1,05		Total de los Países Bajos	14.373.573	3,11
34.505	Pernod-Ricard SA	6.146.675	1,33		REPÚBLICA DE COREA (SUR)		
	Total de Francia	16.699.259	3,61	213.972	Samsung Electronics Company Limited	8.774.303	1,90
ALEMANIA					Total de la República de Corea (Sur)	8.774.303	1,90
29.646	Adidas AG	9.232.228	1,99		ESPAÑA		
	Total de Alemania	9.232.228	1,99	161.719	Industria de Diseño Textil SA	5.007.092	1,08
HONG KONG					Total de España	5.007.092	1,08
452.800	Aia Group Limited	4.277.100	0,92		SUIZA		
	Total de Hong Kong	4.277.100	0,92	37.179	TE Connectivity Limited	3.464.339	0,75
					Total de Suiza	3.464.339	0,75

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
31.214	Aon plc	6.042.094	1,30	57.648	Union Pacific Corp.	9.337.823	2,01
40.609	Reckitt Benckiser Group plc	3.174.694	0,68	14.464	UnitedHealth Group Inc.	3.143.316	0,68
153.642	Unilever plc	9.258.385	2,00	40.722	Vertex Pharmaceuticals Inc.	6.899.122	1,49
	Total del Reino Unido	18.475.173	3,98	66.577	Visa Inc. - A	11.451.910	2,47
					Total de Estados Unidos	275.947.514	59,47
ESTADOS UNIDOS				Total de renta variable			
133.981	Activision Blizzard Inc.	7.090.275	1,53			453.082.218	97,68
21.763	Adobe Inc.	6.012.029	1,30	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
15.579	Alphabet Inc. - A	19.024.140	4,10			453.082.218	97,68
1.982	Alphabet Inc. - C	2.416.058	0,52	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
7.805	Amazon.com Inc.	13.548.777	2,92	Fondos			
50.984	Amphenol Corp.	4.919.956	1,06	IRLANDA			
58.252	Baxter International Inc.	5.095.302	1,10	12.175.736	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	12.175.736	2,63
27.781	Becton Dickinson & Company	7.027.482	1,51		Total de Irlanda	12.175.736	2,63
163.308	Centene Corp.	7.064.704	1,52	Total de fondos			
92.906	Charles Schwab Corp.	3.886.258	0,84			12.175.736	2,63
26.427	CME Group Inc.	5.585.082	1,20	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
130.592	Comcast Corp.	5.887.087	1,27			12.175.736	2,63
19.645	Cooper Companies Inc.	5.834.565	1,26	Valor total de las inversiones			
61.815	Diamondback Energy Inc.	5.557.787	1,20			465.257.954	100,31
28.640	Ecolab Inc.	5.671.866	1,22	(Coste total: USD 424.603.722)			
49.631	Electronic Arts Inc.	4.854.904	1,05				
59.337	Eog Resources Inc.	4.403.992	0,95				
17.842	Equinix Inc.	10.291.266	2,22				
29.783	Estee Lauder Companies Inc.	5.925.328	1,28				
54.532	Facebook Inc. - A	9.711.059	2,09				
35.458	Fidelity National Information Services Inc.	4.707.404	1,01				
87.237	Gilead Sciences Inc.	5.529.081	1,19				
177.991	Halliburton Company	3.355.130	0,72				
21.660	Illumina Inc.	6.589.405	1,42				
100.837	JPMorgan Chase & Company	11.867.506	2,56				
22.364	Lam Research Corp.	5.168.544	1,11				
46.208	Mastercard Inc. - A	12.548.707	2,71				
125.420	Microsoft Corp.	17.437.143	3,75				
14.670	NextEra Energy Inc.	3.417.963	0,74				
26.514	Nvidia Corp.	4.615.292	1,00				
22.003	S&P Global Inc.	5.390.295	1,16				
100.539	Service Corp. International	4.806.770	1,04				
32.126	Stryker Corp.	6.948.854	1,49				
40.618	Transunion	3.294.526	0,71				
53.657	Trex Company Inc.	4.879.031	1,05				
18.102	Tyler Technologies Inc.	4.751.775	1,02				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BAHAMAS				ITALIA			
554.644	OneSpaWorld Holdings Limited	7.900.955	2,06	334.215	Carel Industries SpA	4.538.640	1,18
	Total de Bahamas	7.900.955	2,06	69.394	Diasorin SpA	7.404.340	1,92
BERMUDAS				579.374	Finecobank Banca Fineco SpA	5.626.880	1,46
238.918	Axalta Coating System Limited	6.607.391	1,71	520.191	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	4.952.218	1,29
	Total de Bermudas	6.607.391	1,71	219.503	Marr SpA	4.412.010	1,15
CANADÁ					Total de Italia	26.934.088	7,00
112.254	Cargojet Inc.	7.319.638	1,90	JAPÓN			
157.655	Gildan Activewear Inc.	5.135.659	1,34	157.600	Asahi Intecc Company Limited	3.794.757	0,99
205.705	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	7.528.553	1,96	95.200	Daifuku Company Limited	4.500.498	1,17
	Total de Canadá	19.983.850	5,20	42.800	Disco Corp.	7.432.207	1,93
DINAMARCA				276.286	Nihon M&A Center Inc.	7.128.545	1,85
41.924	Simcorp A/S	3.377.479	0,88	106.200	Pigeon Corp.	4.015.509	1,04
	Total de Dinamarca	3.377.479	0,88	118.900	Raksul Inc.	3.602.620	0,94
FRANCIA					Total de Japón	30.474.136	7,92
229.022	Elis SA	3.714.737	0,97	LUXEMBURGO			
211.871	Lectra	3.834.865	1,00	15.626	Eurofins Scientific	6.662.926	1,74
35.036	Orpea	3.927.536	1,02		Total de Luxemburgo	6.662.926	1,74
52.233	Remy Cointreau	6.361.979	1,65	PAÍSES BAJOS			
	Total de Francia	17.839.117	4,64	93.289	Core Laboratories NV	3.989.298	1,04
ALEMANIA				44.661	IMCD Group NV	3.030.249	0,79
76.636	CTS Eventim AG	3.962.081	1,03	48.911	Takeaway.com Holding BV	3.580.285	0,93
64.383	Grenke AG	4.867.355	1,27		Total de los Países Bajos	10.599.832	2,76
233.168	Norma Group	7.419.405	1,92	SUECIA			
9.378	Sartorius AG	1.569.877	0,41	547.126	Dometic Group AB	3.941.503	1,03
118.631	Stabilus SA	5.326.531	1,39	1.433.722	Karnov Group AB	6.420.234	1,67
	Total de Alemania	23.145.249	6,02		Total de Suecia	10.361.737	2,70
ISLANDIA				SUIZA			
876.592	Marel HF	3.681.686	0,96	1.143	Belimo Holding AG - Reg	5.772.339	1,50
	Total de Islandia	3.681.686	0,96	2.316	LEM Holding SA	2.535.238	0,66
INDIA				425.089	SIG Combibloc Group AG	5.200.736	1,35
213.427	Colgate-Palmolive Company	4.154.650	1,08	60.881	Vat Group AG	7.048.038	1,83
6.661	Eicher Motors Limited	1.531.656	0,40	20.219	VZ Holding AG	5.542.545	1,44
	Total de India	5.686.306	1,48		Total de Suiza	26.098.896	6,78

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
REINO UNIDO				IRLANDA			
870.597	Ascential plc	3.729.638	0,97	6.004.904	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	5.508.076	1,43
393.711	Big Yellow Group plc	4.623.846	1,20		Total de Irlanda	5.508.076	1,43
69.747	Croda International plc	3.831.528	1,00				
215.064	Genus plc	6.787.243	1,77		Total de fondos	5.508.076	1,43
397.923	St James's Place plc	4.405.238	1,15		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	5.508.076	1,43
	Total del Reino Unido	23.377.493	6,09		Valor total de las inversiones	383.259.858	99,68
ESTADOS UNIDOS					(Coste total: EUR 360.279.438)		
230.981	Altair Engineering Inc.	7.334.949	1,90				
59.129	Aspen Technology Inc.	6.675.470	1,74				
75.692	Blackline Inc.	3.319.423	0,86				
97.199	Casella Waste Systems Inc.	3.828.403	1,00				
57.116	Catalent Inc.	2.496.926	0,65				
62.220	Charles River Laboratories International Inc.	7.554.634	1,96				
117.308	Cubic Corp.	7.578.428	1,97				
60.401	Envestnet Inc.	3.141.384	0,82				
12.046	Fair Isaac Corp.	3.353.698	0,87				
108.688	Freshpet Inc.	4.961.843	1,29				
61.916	Gatx Corp.	4.403.181	1,15				
122.823	Graco Inc.	5.186.912	1,35				
51.889	Guardant Health Inc.	3.038.043	0,79				
79.568	MSA Safety Inc.	7.963.369	2,07				
52.855	Nordson Corp.	7.090.967	1,84				
64.584	Novanta Inc.	4.841.134	1,26				
42.737	Pool Corp.	7.906.855	2,06				
77.003	PTC Inc.	4.815.689	1,25				
164.100	Service Corp. International	7.196.497	1,87				
57.646	Servicemaster Global Holdings Inc.	2.955.798	0,77				
116.450	SiteOne Landscape Supply Inc.	7.906.466	2,06				
50.466	Transunion	3.754.630	0,98				
101.536	Trex Company Inc.	8.468.784	2,20				
177.615	Trimble Inc.	6.322.912	1,64				
29.783	Tyler Technologies Inc.	7.171.196	1,87				
21.398	Watsco Inc.	3.320.596	0,86				
32.056	WD-40 Company	5.396.770	1,40				
251.178	Welbilt Inc.	3.884.481	1,01				
16.647	Zebra Technologies Corp.	3.151.203	0,82				
	Total de Estados Unidos	155.020.641	40,31				
	Total de renta variable	377.751.782	98,25				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	377.751.782	98,25				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
IRLANDA				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
153.097	Ingersoll-Rand plc	18.863.081	2,00	427.865	Microsoft Corp.	59.486.072	6,33
	Total de Irlanda	18.863.081	2,00	345.511	Mondelez International Inc.	19.113.669	2,03
				240.544	Procter & Gamble Company	29.918.863	3,18
PAÍSES BAJOS				184.635	Republic Services Inc.	15.980.159	1,70
112.898	NXP Semiconductor NV	12.319.430	1,31	16.645	Sage Therapeutics Inc.	2.335.127	0,25
	Total de los Países Bajos	12.319.430	1,31	68.368	Spirit Aerosystems Holdings Inc.	5.622.584	0,60
ESTADOS UNIDOS				127.102	Take-Two Interactive Software Inc.	15.930.965	1,69
71.164	Adobe Inc.	19.659.055	2,09	66.907	Thermo Fisher Scientific Inc.	19.488.002	2,07
167.697	Aflac Inc.	8.773.907	0,93	131.309	Union Pacific Corp.	21.269.432	2,26
60.356	Albemarle Corp.	4.195.949	0,45	146.637	Valero Energy Corp.	12.499.338	1,33
91.884	Alexion Pharmaceuticals Inc.	8.999.119	0,96	69.445	Vertex Pharmaceuticals Inc.	11.765.373	1,25
137.794	Allstate Corp.	14.975.452	1,59	148.674	Visa Inc. - A	25.573.415	2,71
34.929	Alphabet Inc. - A	42.653.199	4,53	95.551	Voya Financial Inc.	5.201.796	0,55
22.003	Amazon.com Inc.	38.195.228	4,06		Total de Estados Unidos	897.650.042	95,40
57.721	American Tower Corp.	12.763.845	1,36		Total de renta variable	928.832.553	98,71
237.959	Apple Inc.	53.295.677	5,66		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	928.832.553	98,71
1.052.083	Bank of America Corp.	30.689.261	3,27		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
235.771	Baxter International Inc.	20.622.889	2,19		Fondos		
125.908	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	8.486.199	0,90		IRLANDA		
20.626	Bluebird Bio Inc.	1.893.879	0,20	9.517.661	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.517.661	1,01
281.275	Bristol-Myers Squibb Company	14.263.455	1,52		Total de Irlanda	9.517.661	1,01
57.470	Broadcom Inc.	15.865.743	1,69		Total de fondos	9.517.661	1,01
109.611	Caterpillar Inc.	13.844.966	1,47		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	9.517.661	1,01
232.903	Centene Corp.	10.075.384	1,07		Valor total de las inversiones	938.350.214	99,72
163.873	Chevron Corp.	19.435.337	2,06		(Coste total: USD 834.821.403)		
447.335	Cisco Systems Inc.	22.102.822	2,35				
382.927	Citigroup Inc.	26.452.597	2,81				
392.872	Citizens Financial Group Inc.	13.895.883	1,48				
80.012	CME Group Inc.	16.909.736	1,80				
564.477	Comcast Corp.	25.446.623	2,70				
93.782	Diamondback Energy Inc.	8.431.940	0,90				
106.151	Dow Inc.	5.058.095	0,53				
146.166	DuPont de Nemours Inc.	10.423.097	1,11				
262.777	Edison International	19.818.641	2,11				
117.076	Eog Resources Inc.	8.689.381	0,92				
303.146	Extended Stay America Inc.	4.438.057	0,47				
171.736	Facebook Inc. - A	30.582.747	3,25				
209.587	Gardner Denver Holdings Inc.	5.929.216	0,63				
62.211	Guardant Health Inc.	3.970.928	0,42				
131.587	Home Depot Inc.	30.530.816	3,24				
100.920	L3Harris Technologies Inc.	21.055.949	2,24				
72.689	Lam Research Corp.	16.799.154	1,78				
178.849	Marsh & McLennan Companies Inc.	17.893.843	1,91				
97.018	Mastercard Inc. - A	26.347.178	2,80				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Select

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
IRLANDA				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
22.499	Ingersoll-Rand plc	2.772.102	0,77	88.192	Visa Inc. - A	15.169.906	4,23
	Total de Irlanda	2.772.102	0,77	12.042	VMware Inc. - A	1.807.023	0,50
PAÍSES BAJOS				26.710	Walt Disney Company	3.480.847	0,97
43.929	NXP Semiconductor NV	4.793.532	1,34	591.569	WPX Energy Inc.	6.264.716	1,75
	Total de los Países Bajos	4.793.532	1,34	Total de Estados Unidos		331.912.995	92,62
ESTADOS UNIDOS				Total de renta variable		339.478.629	94,73
21.720	Activision Blizzard Inc.	1.149.422	0,32	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		339.478.629	94,73
28.017	Adobe Inc.	7.739.696	2,16	Valor total de las inversiones		339.478.629	94,73
44.151	Alexion Pharmaceuticals Inc.	4.324.149	1,20	(Coste total: USD 313.110.720)			
26.946	Alphabet Inc. - A	32.904.839	9,18				
9.853	Amazon.com Inc.	17.103.921	4,77				
21.738	Analog Devices Inc.	2.428.787	0,68				
14.314	Ansys Inc.	3.168.547	0,88				
28.348	Apple Inc.	6.349.102	1,77				
403.923	Bank of America Corp.	11.782.434	3,29				
141.503	Berkshire Hathaway Inc.	29.435.454	8,21				
16.728	Biogen Idec Inc.	3.894.613	1,09				
52.097	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	3.511.338	0,98				
4.064	Booking Holdings Inc.	7.976.047	2,23				
500.871	Centennial Resource Development - A	2.261.433	0,63				
12.670	Charter Communications Inc. - A	5.221.560	1,46				
15.511	Colgate-Palmolive Company	1.140.214	0,32				
197.235	Comcast Corp.	8.891.354	2,48				
7.651	Curtiss-Wright Corp.	989.810	0,28				
24.210	Edwards Lifesciences Corp.	5.324.021	1,49				
101.143	Facebook Inc. - A	18.011.545	5,02				
6.161	Illumina Inc.	1.874.299	0,52				
106.393	JPMorgan Chase & Company	12.521.392	3,49				
26.300	L3Harris Technologies Inc.	5.487.232	1,53				
66.648	Lam Research Corp.	15.403.020	4,29				
25.949	Mastercard Inc. - A	7.046.970	1,97				
220.861	Microsoft Corp.	30.706.304	8,57				
66.878	Moderna Inc.	1.064.698	0,30				
103.502	Mondelez International Inc.	5.725.731	1,60				
35.012	Norfolk Southern Corp.	6.290.256	1,76				
241.865	Nutanix Inc. - A	6.348.956	1,77				
36.742	PepsiCo Inc.	5.037.328	1,41				
48.526	Phillips 66	4.969.062	1,39				
61.757	PNC Financial Services	8.655.861	2,42				
351.954	Uber Technologies Inc.	10.724.038	2,99				
29.788	UnitedHealth Group Inc.	6.473.528	1,81				
19.204	Vertex Pharmaceuticals Inc.	3.253.542	0,91				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BAHAMAS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
238.340	OneSpaWorld Holdings Limited	3.701.420	1,62	89.490	Quanterix Corp.	1.965.200	0,86
	Total de Bahamas	3.701.420	1,62	42.206	Sandy Spring Bancorp Inc.	1.422.764	0,62
CANADÁ				59.761	Schnitzer Steel Industries Inc.	1.234.662	0,54
54.694	Canada Goose Holdings Inc.	2.404.895	1,06	193.936	Store Capital Corp.	7.255.146	3,18
217.791	Gildan Activewear Inc.	7.731.581	3,39	36.459	Take-Two Interactive Software Inc.	4.569.771	2,01
70.428	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	2.810.077	1,23	79.892	Teradyne Inc.	4.626.546	2,03
	Total de Canadá	12.946.553	5,68	30.370	Trex Company Inc.	2.761.544	1,21
ESTADOS UNIDOS				577.288	Virtu Financial Inc.	9.444.431	4,14
114.333	Aerie Pharmaceuticals Inc.	2.197.480	0,97	61.395	Voya Financial Inc.	3.342.344	1,47
20.264	Aerojet Rocketdyne Holdings Inc.	1.023.535	0,45	176.779	W&t Offshore Inc.	772.524	0,34
160.457	Albemarle Corp.	11.154.971	4,89	30.300	Zebra Technologies Corp.	6.253.011	2,74
312.675	Altair Engineering Inc.	10.824.809	4,75		Total de Estados Unidos	211.114.074	92,65
90.745	BJ's Wholesale Club Holdings Inc.	2.347.573	1,03	Total de renta variable			
85.567	Charles River Laboratories International Inc.	11.326.504	4,98			227.762.047	99,95
166.888	Cubic Corp.	11.753.922	5,16	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
155.316	Elf Beauty Inc.	2.719.583	1,19			227.762.047	99,95
86.198	Extended Stay America Inc.	1.261.939	0,55	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
141.145	First Hawaiian Inc.	3.768.572	1,66	Fondos			
187.314	First Industrial Realty Trust Inc.	7.410.141	3,26	IRLANDA			
47.611	Freshpet Inc.	2.369.600	1,04	1.300.000	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.300.000	0,57
145.468	Gardner Denver Holdings Inc.	4.115.290	1,81		Total de Irlanda	1.300.000	0,57
63.733	Guardant Health Inc.	4.068.077	1,78	Total de fondos			
44.918	Hanover Insurance Group	6.088.186	2,67			1.300.000	0,57
174.882	Houlihan Lokey Inc.	7.887.178	3,46	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
56.664	Immunomedics Inc.	751.365	0,33			1.300.000	0,57
130.299	Impinj Inc.	4.017.118	1,76	Valor total de las inversiones			
390.280	KBR Inc.	9.577.471	4,20			229.062.047	100,52
347.759	Kindred Biosciences Inc.	2.382.149	1,05	(Coste total: USD 222.280.210)			
419.899	Livent Corp	2.809.124	1,23				
17.855	Medifast Inc.	1.850.314	0,81				
27.301	Mirati Therapeutics Inc.	2.127.021	0,93				
35.425	Mobile Mini Inc.	1.305.766	0,57				
170.750	Moelis & Company - A	5.609.137	2,46				
33.051	MSA Safety Inc.	3.606.195	1,58				
1.005.590	Newpark Resources	7.662.596	3,36				
10.988	Nordson Corp.	1.607.105	0,71				
169.708	Planet Fitness Inc.	9.821.002	4,31				
160.830	Portland General Electric Company	9.065.987	3,98				
190.658	QTS Realty Trust Inc. - A	9.801.727	4,31				
45.564	Quanex Building Products Corp.	823.797	0,36				
114.574	Quanta Services Inc.	4.330.897	1,91				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

[illegible]

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
SINGAPUR			
118.000	DBS Group Holdings Limited	2.133.198	1,40
1.239.000	Lendlease Global Commercial REIT	788.430	0,52
	Total de Singapur	2.921.628	1,92
TAIWÁN			
349.000	MediaTek Inc.	4.150.998	2,72
828.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	7.259.388	4,76
203.000	Yageo Corp.	1.612.923	1,06
	Total de Taiwán	13.023.309	8,54
TAILANDIA			
359.100	Bangkok Bank plc - NVDR	2.037.087	1,34
201.600	Kasikornbank plc - NVDR	1.031.572	0,68
2.765.000	Thai Beverage plc	1.769.488	1,16
	Total de Tailandia	4.838.147	3,18
	Total de renta variable	147.490.137	96,71
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	147.490.137	96,71
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
3.525.592	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.525.592	2,31
	Total de Irlanda	3.525.592	2,31
	Total de fondos	3.525.592	2,31
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	3.525.592	2,31
	Valor total de las inversiones	151.015.729	99,02
(Coste total: USD 151.368.095)			

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				HONG KONG (continuación)			
212.655	Amcor plc	2.043.809	0,90	215.500	Sun Hung Kai Properties Limited	3.100.804	1,37
155.915	Aristocrat Leisure Limited	3.217.800	1,42	305.500	Techtronic Industries Company	2.125.807	0,94
240.144	Australia & New Zealand Banking Group Limited	4.619.245	2,04	Total de Hong Kong		30.170.951	13,35
319.945	BHP Group Limited	7.923.695	3,50	INDIA			
40.044	CSL Limited	6.311.424	2,79	189.676	Godrej Consumer Products Limited	1.839.571	0,81
385.735	Lendlease Group	4.568.392	2,02	342.500	HDFC Bank Limited	5.932.288	2,63
52.298	Macquarie Group Limited	4.623.504	2,04	287.317	Icici Bank Limited	1.758.363	0,78
178.496	Treasury Wine Estates Limited	2.235.580	0,99	210.266	Infosys Technologies Limited	2.390.415	1,06
Total de Australia		35.543.449	15,70	178.432	Mahindra & Mahindra Limited	1.377.644	0,61
ISLAS CAIMÁN				835.400	Petronet Lng Limited	3.063.787	1,35
76.816	Alibaba Group Holding Limited	12.845.939	5,68	147.425	Reliance Industries Limited	2.771.499	1,23
666.816	China Resources Land Limited	2.794.212	1,24	Total de India		19.133.567	8,47
27.224	New Oriental Education & Technology Group - ADR	3.015.330	1,33	INDONESIA			
836.800	Sands China Limited	3.789.378	1,68	13.923.200	Bank Rakyat Indonesia	4.041.264	1,79
297.200	Tencent Holdings Limited	12.518.255	5,53	12.239.500	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	3.716.395	1,64
Total de las Islas Caimán		34.963.114	15,46	Total de Indonesia		7.757.659	3,43
CHINA				FILIPINAS			
546.000	Anhui Conch Cement Company Limited	3.242.129	1,43	3.174.690	Ayala Land Inc.	3.028.935	1,34
4.675.000	China Construction Bank Corp.	3.566.159	1,58	2.081.120	Metropolitan Bank & Trust	2.746.474	1,21
1.014.000	China Merchants Bank Company Limited - H	4.824.638	2,13	Total de Filipinas		5.775.409	2,55
2.559.000	CRRC Corp. Limited	1.785.564	0,79	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
577.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	6.627.923	2,93	63.798	Hite Jinro Company Limited	1.450.750	0,64
137.200	Shanghai International Airport - A	1.532.765	0,68	58.110	KB Financial Group Inc.	2.074.414	0,92
232.077	Wuliangye Yibin Company Limited	4.218.267	1,86	41.972	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	3.614.212	1,60
Total de China		25.797.445	11,40	350.663	Samsung Electronics Company Limited	14.379.561	6,36
HONG KONG				16.681	Samsung Sdi Company Limited	3.109.880	1,38
986.400	Aia Group Limited	9.317.427	4,12	Total de la República de Corea (Sur)		24.628.817	10,90
253.000	China Mobile Limited	2.092.900	0,93	SINGAPUR			
2.739.000	Cnooc Limited	4.178.699	1,85	1.215.500	Capitaland Limited	3.102.692	1,37
1.058.000	CSPC Pharmaceutical Group Limited	2.124.263	0,94	282.900	United Overseas Bank Limited	5.249.268	2,33
616.000	Galaxy Entertainment Group Limited	3.830.657	1,69	Total de Singapur		8.351.960	3,70
115.900	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	3.400.394	1,51				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
TAIWÁN			
348.000	Chroma ATE Inc.	1.648.911	0,73
3.755.281	E.Sun Financial Holding Company Limited	3.177.404	1,40
18.000	Largan Precision Company Limited	2.581.864	1,14
459.000	MediaTek Inc.	5.459.335	2,41
1.594.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	13.975.197	6,18
	Total de Taiwán	26.842.711	11,86
TAILANDIA			
367.900	Kasikornbank pcl - NVDR	1.882.516	0,83
757.700	Thai Oil pcl	1.727.970	0,76
	Total de Tailandia	3.610.486	1,59
	Total de renta variable	222.575.568	98,41
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	222.575.568	98,41
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
2.004.971	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.004.971	0,89
	Total de Irlanda	2.004.971	0,89
	Total de fondos	2.004.971	0,89
	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.004.971	0,89
	Valor total de las inversiones	224.580.539	99,30
(Coste total: USD 211.816.156)			

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
Renta variable			
AUSTRALIA			
16.125	Amcor plc	154.976	1,50
5.601	Ansell Limited	103.544	1,00
9.789	Aristocrat Leisure Limited	202.027	1,96
8.809	Australia & New Zealand Banking Group Limited	169.444	1,64
14.619	BHP Group Limited	362.051	3,51
1.877	CSL Limited	295.838	2,87
21.396	Lendlease Group	253.400	2,46
2.425	Macquarie Group Limited	214.387	2,08
14.038	Treasury Wine Estates Limited	175.820	1,71
66.258	Vicinity Centres	114.847	1,11
	Total de Australia	2.046.334	19,84
BERMUDAS			
334.000	Beijing Enterprises Water Group Limited	170.848	1,66
	Total de Bermudas	170.848	1,66
ISLAS CAIMÁN			
836	Alibaba Group Holding Limited	139.804	1,35
19.000	CK Asset Holdings Limited	128.696	1,25
13.500	CK Hutchison Holdings Limited	119.167	1,16
76.400	Mgm China Holdings Limited	119.092	1,15
3.100	Tencent Holdings Limited	130.574	1,27
	Total de las Islas Caimán	637.333	6,18
CHINA			
223.000	Times China Holdings Ltd	347.042	3,36
	Total de China	347.042	3,36
HONG KONG			
100.200	Aia Group Limited	946.478	9,18
35.000	Boc Hong Kong Holdings Limited	118.759	1,15
50.000	Galaxy Entertainment Group Limited	310.930	3,02
5.100	Hang Seng Bank Limited	109.945	1,07
16.669	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	489.052	4,74
72.000	Hua Hong Semiconductor Limited	143.277	1,39
39.500	Kerry Properties Limited	121.684	1,18
27.500	Link Real Estate Investment Trust	303.260	2,94
VALORES MOBILIARIOS E INSTRUMENTOS DEL MERCADO MONETARIO ADMITIDOS OFICIALMENTE A COTIZACIÓN EN BOLSA (continuación)			
Renta variable (continuación)			
HONG KONG (continuación)			
469.000	Pacific Basin Shipping Limited	95.722	0,93
362.000	Sinopec Kantons Holdings Limited	148.690	1,44
	Total de Hong Kong	2.787.797	27,04
MACAO			
88.400	Wynn Macao Limited	172.529	1,67
	Total de Macao	172.529	1,67
REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
1.819	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	156.634	1,52
	Total de la República de Corea (Sur)	156.634	1,52
SINGAPUR			
113.200	Capitaland Limited	288.955	2,80
46.700	DBS Group Holdings Limited	844.241	8,18
91.700	Lendlease Global Commercial REIT	58.353	0,57
106.700	Mapletree Commercial Trust	176.689	1,71
71.118	Oversea-Chinese Banking Corp. Limited	558.494	5,41
261.300	Singapore Telecommunications Limited	585.747	5,68
35.935	United Overseas Bank Limited	666.782	6,46
24.400	UOL Group Limited	132.331	1,28
	Total de Singapur	3.311.592	32,09
TAIWÁN			
19.000	MediaTek Inc.	225.985	2,19
16.000	Yageo Corp.	127.127	1,23
	Total de Taiwán	353.112	3,42
TAILANDIA			
163.500	Thai Beverage plc	104.633	1,01
	Total de Tailandia	104.633	1,01
	Total de renta variable	10.087.854	97,79
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	10.087.854	97,79
	Valor total de las inversiones	10.087.854	97,79
	(Coste total: USD 9.575.938)		

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BERMUDAS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
118.845	Marvell Technology Group Limited	2.967.560	0,45	26.625	Becton Dickinson & Company	6.735.060	1,02
	Total de Bermudas	2.967.560	0,45	126.697	Berkshire Hathaway Inc.	26.355.510	3,98
CANADÁ				14.891	Blackrock Inc.	6.636.026	1,00
189.620	Canadian Natural Resources Limited	5.049.581	0,76	12.585	Broadcom Inc.	3.474.341	0,52
	Total de Canadá	5.049.581	0,76	8.310	Caterpillar Inc.	1.049.636	0,16
CURASAO				53.195	CDK Global Inc.	2.558.148	0,39
81.080	Schlumberger Limited	2.770.504	0,42	131.249	Chevron Corp.	15.566.131	2,35
	Total de Curasao	2.770.504	0,42	31.196	Cigna Corp.	4.735.241	0,71
IRLANDA				132.335	Cisco Systems Inc.	6.538.672	0,99
31.870	Allergan plc	5.363.402	0,81	252.255	Citigroup Inc.	17.425.775	2,63
181.591	Medtronic Inc.	19.724.415	2,98	74.895	Colgate-Palmolive Company	5.505.531	0,83
	Total de Irlanda	25.087.817	3,79	421.198	Comcast Corp.	18.987.606	2,87
PAÍSES BAJOS				228.769	Conagra Brands Inc.	7.018.633	1,06
61.920	NXP Semiconductor NV	6.756.710	1,02	117.050	Corning Inc.	3.338.266	0,50
	Total de los Países Bajos	6.756.710	1,02	134.707	Corteva Inc.	3.771.796	0,57
REINO UNIDO				109.340	Dentsply Sirona Inc.	5.828.915	0,88
41.769	Aon plc	8.085.225	1,22	87.450	DR Horton Inc.	4.609.490	0,70
	Total del Reino Unido	8.085.225	1,22	87.572	DuPont de Nemours Inc.	6.244.759	0,94
ESTADOS UNIDOS				208.980	Ebay Inc.	8.146.040	1,23
65.533	Abbott Laboratories	5.483.146	0,83	37.380	Electronic Arts Inc.	3.656.512	0,55
159.189	Activision Blizzard Inc.	8.424.282	1,27	81.443	Emerson Electric Company	5.445.279	0,82
27.060	Adobe Inc.	7.475.325	1,13	104.082	Eog Resources Inc.	7.724.966	1,17
14.995	Air Products & Chemicals Inc.	3.326.791	0,50	48.330	Facebook Inc. - A	8.606.606	1,30
25.130	Alexion Pharmaceuticals Inc.	2.461.232	0,37	97.435	Fidelity National Information Services Inc.	12.935.471	1,95
9.479	Alphabet Inc. - A	11.575.186	1,75	82.448	Fiserv Inc.	8.540.788	1,29
12.490	Alphabet Inc. - C	15.225.310	2,30	80.829	Honeywell International Inc.	13.676.267	2,07
11.460	Amazon.com Inc.	19.893.529	3,00	2.565	Humana Inc.	655.794	0,10
74.065	American Electric Power Company Inc.	6.939.150	1,05	62.395	IBM Corp.	9.073.481	1,37
40.679	American Tower Corp.	8.995.347	1,36	77.020	Intel Corp.	3.968.841	0,60
17.369	Anthem Inc.	4.170.296	0,63	96.896	Johnson & Johnson	12.536.405	1,89
120.756	Apple Inc.	27.045.721	4,08	168.563	JPMorgan Chase & Company	19.838.179	2,99
114.971	Aramark	5.010.436	0,76	27.325	L3Harris Technologies Inc.	5.701.088	0,86
357.035	AT&T Inc.	13.510.204	2,04	30.825	Lam Research Corp.	7.123.966	1,08
15.310	Autodesk Inc.	2.261.287	0,34	110.002	Lowe's Companies Inc.	12.095.820	1,82
53.905	Baxter International Inc.	4.715.070	0,71	68.824	Mastercard Inc. - A	18.690.534	2,82
				40.651	McDonald's Corp.	8.728.176	1,32
				274.131	Microsoft Corp.	38.112.433	5,74
				188.115	Mondelez International Inc.	10.406.522	1,57
				241.980	Morgan Stanley	10.325.287	1,56
				107.055	Mosaic Company	2.194.628	0,33
				180.175	Newmont Mining Corp.	6.832.236	1,03
				36.975	Northrop Grumman Corp.	13.857.860	2,09
				28.660	Nvidia Corp.	4.988.846	0,75
				12.695	Palo Alto Networks Inc.	2.587.622	0,39
				191.974	Pfizer Inc.	6.897.626	1,04
				163.790	Philip Morris International Inc.	12.436.575	1,88
				7.537	Sherwin-Williams Company	4.144.369	0,63

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
34.055	Spirit Aerosystems Holdings Inc.	2.800.683	0,42
34.567	Sysco Corp.	2.744.620	0,41
46.200	T-Mobile USA Inc.	3.639.174	0,55
31.910	Valero Energy Corp.	2.720.008	0,41
153.796	Verizon Communications Inc.	9.283.127	1,40
71.625	Wells Fargo & Company	3.612.765	0,55
Total de Estados Unidos		597.620.442	90,20
Total de renta variable		648.337.839	97,86
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		648.337.839	97,86
Valor total de las inversiones		648.337.839	97,86
(Coste total: USD 527.242.375)			

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
ISLAS CAIMÁN				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
75	Garmin Limited	6.352	0,10	1.790	Conocophillips	101.995	1,64
	Total de las Islas Caimán	6.352	0,10	265	CSX Corp.	18.357	0,29
IRLANDA				701	Cummins Inc.	114.032	1,83
88	Allergan plc	14.810	0,24	235	Dentsply Sirona Inc.	12.528	0,20
960	Eaton Corp. plc	79.824	1,28	2.160	Ebay Inc.	84.197	1,35
448	Medtronic Inc.	48.662	0,78	172	Eli Lilly & Company	19.235	0,31
380	Perrigo Company	21.238	0,34	2.300	Exelon Corp.	111.113	1,78
104	Willis Towers Watson plc	20.069	0,32	600	Expedia Group Inc.	80.646	1,29
	Total de Irlanda	184.603	2,96	74	F5 Networks Inc.	10.391	0,17
PAÍSES BAJOS				1.071	Facebook Inc. - A	190.724	3,05
849	Lyondellbasell Industries NV - A	75.960	1,22	475	Fortinet Inc.	36.461	0,58
760	Mylan NV	15.033	0,24	1.990	Franklin Resources Inc.	57.431	0,92
	Total de los Países Bajos	90.993	1,46	430	General Mills Inc.	23.702	0,38
REINO UNIDO				565	Harley-Davidson Inc.	20.323	0,33
130	Aon plc	25.164	0,40	655	Hollyfrontier Corp.	35.134	0,56
	Total del Reino Unido	25.164	0,40	145	Hologic Inc.	7.321	0,12
ESTADOS UNIDOS				413	Honeywell International Inc.	69.879	1,12
650	Abbott Laboratories	54.386	0,87	365	Host Hotels & Resorts Inc.	6.311	0,10
565	Abbvie Inc.	42.782	0,68	3.430	HP Inc.	64.896	1,04
232	Adobe Inc.	64.090	1,03	167	Illinois Tool Works Inc.	26.134	0,42
3.185	AES Corp.	52.043	0,83	1.350	IntercontinentalExchange Inc.	124.565	2,00
327	Alexion Pharmaceuticals Inc.	32.026	0,51	412	Johnson & Johnson	53.305	0,85
550	Allstate Corp.	59.774	0,96	766	Kimberly-Clark Corp.	108.810	1,74
237	Alphabet Inc. - A	289.410	4,63	129	L3Harris Technologies Inc.	26.914	0,43
1.680	Altria Group Inc.	68.712	1,10	452	Lam Research Corp.	104.462	1,67
82	Amazon.com Inc.	142.345	2,28	42	Lockheed Martin Corp.	16.383	0,26
440	American Electric Power Company Inc.	41.224	0,66	628	Mastercard Inc. - A	170.546	2,73
532	American Tower Corp.	117.641	1,88	516	Mckesson Corp.	70.517	1,13
619	Apple Inc.	138.637	2,22	1.830	Merck & Company Inc.	154.048	2,47
74	Autozone Inc.	80.262	1,28	745	Metlife Inc.	35.134	0,56
900	Bank of America Corp.	26.253	0,42	1.172	Microsoft Corp.	162.943	2,61
345	Bank of New York Mellon Corp.	15.597	0,25	765	Nike Inc.	71.849	1,15
640	Baxter International Inc.	55.981	0,89	750	Nrg Energy Inc.	29.700	0,48
280	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	18.872	0,30	1.555	Nucor Corp.	79.165	1,27
2.410	Bristol-Myers Squibb Company	122.210	1,96	1.255	Paypal Holdings Inc.	130.005	2,08
427	Broadcom Inc.	117.881	1,88	730	Philip Morris International Inc.	55.429	0,89
1.150	Capital One Financial Corp.	104.627	1,67	72	Procter & Gamble Company	8.955	0,14
1.705	Cardinal Health Inc.	80.459	1,29	642	Prudential Financial Inc.	57.748	0,92
622	Chevron Corp.	73.769	1,18	55	Qorvo Inc.	4.078	0,07
3.175	Cisco Systems Inc.	156.877	2,51	305	Robert Half International Inc.	16.976	0,27
2.225	Citigroup Inc.	153.703	2,46	41	S&P Global Inc.	10.044	0,16
				68	SBA Communications	16.398	0,26
				264	Simon Property Group Inc.	41.092	0,66
				424	Snap-On Inc.	66.373	1,06
				2.030	Southwest Airlines Company	109.641	1,75
				1.475	Starbucks Corp.	130.420	2,08
				760	Synchrony Financial	25.908	0,41
				142	T Rowe Price Group Inc.	16.224	0,26
				510	Tyson Foods Inc. - A	43.931	0,70

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
970	Under Armour Inc.	19.342	0,31
206	Union Pacific Corp.	33.367	0,54
714	Valero Energy Corp.	60.861	0,97
575	VeriSign Inc.	108.462	1,74
2.775	Verizon Communications Inc.	167.499	2,68
200	Vertex Pharmaceuticals Inc.	33.884	0,55
273	Visa Inc. - A	46.959	0,75
334	VMware Inc. - A	50.120	0,80
970	Voya Financial Inc.	52.807	0,85
1.520	Walgreens Boots Alliance Inc.	84.071	1,35
730	Wal-Mart Stores Inc.	86.636	1,39
Total de Estados Unidos		5.885.942	94,21
Total de renta variable		6.193.054	99,13
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		6.193.054	99,13
Valor total de las inversiones		6.193.054	99,13
(Coste total: USD 5.641.026)			

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
DINAMARCA				ITALIA			
24.796	DSV A/S	2.164.663	1,06	335.073	Finecobank Banca Fineco SpA	3.254.229	1,60
125.295	Novo-Nordisk A/S	5.909.567	2,91	54.459	Moncler SpA	1.780.809	0,87
	Total de Dinamarca	8.074.230	3,97		Total de Italia	5.035.038	2,47
FINLANDIA				PAÍSES BAJOS			
94.330	Neste Oyj	2.864.802	1,41	29.698	ASML Holding NV	6.748.871	3,31
53.369	Sampo Oyj - A	1.946.901	0,96	18.263	Ferrari NV	2.585.128	1,27
	Total de Finlandia	4.811.703	2,37	421.278	ING Groep NV	4.045.954	1,99
FRANCIA				66.980	Philips NV	2.846.650	1,40
37.869	Air Liquide SA	4.945.691	2,43	263.181	RELX plc	5.745.241	2,82
15.995	Dassault Systemes SA	2.091.346	1,03		Total de los Países Bajos	21.971.844	10,79
31.552	L'Oréal SA	2.066.025	1,01	NORUEGA			
23.260	L'Oréal SA	5.975.494	2,93	248.387	Dnb ASA	4.018.373	1,97
18.709	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	6.822.237	3,35	68.920	Mowi ASA	1.460.431	0,72
26.286	Pernod-Ricard SA	4.295.132	2,11		Total de Noruega	5.478.804	2,69
28.205	Sanofi	2.399.117	1,18	ESPAÑA			
18.296	Teleperformance	3.639.074	1,79	15.210	Amadeus IT Holding SA - A	999.601	0,49
101.735	Total SA	4.871.580	2,39	117.408	Grifols SA	3.174.712	1,56
45.741	Ubisoft Entertainment	3.034.459	1,48		Total de España	4.174.313	2,05
35.329	Vinci SA	3.491.212	1,71	SUECIA			
	Total de Francia	43.631.367	21,41	104.347	Atlas Copco AB - A	2.951.576	1,45
ALEMANIA				271.398	Sandvik AB	3.882.711	1,91
18.394	Adidas AG	5.254.246	2,58		Total de Suecia	6.834.287	3,36
24.731	Allianz SE - Reg	5.288.724	2,59	SUIZA			
40.229	Knorr-Bremse AG	3.469.349	1,70	9.325	Lonza Group AG - Reg	2.894.191	1,42
46.150	Puma SE	3.276.650	1,61	79.027	Nestle SA - Reg	7.871.491	3,86
25.048	SAP SE	2.702.178	1,33	65.700	Novartis AG - Reg	5.230.167	2,57
52.058	TeamViewer AG	1.285.312	0,63	4.347	Partners Group Holding AG - Reg	3.062.233	1,50
43.865	Vonovia SE	2.041.916	1,00	33.966	Sika AG	4.561.740	2,24
	Total de Alemania	23.318.375	11,44		Total de Suiza	23.619.822	11,59
IRLANDA				REINO UNIDO			
185.589	CRH plc	5.848.645	2,87	332.012	3i Group plc	4.377.728	2,15
88.983	Kingspan Group plc	3.986.438	1,96	218.472	Glaxosmithkline plc	4.308.260	2,11
	Total de Irlanda	9.835.083	4,83				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
17.332	Linde plc	3.085.096	1,51
132.661	Persimmon plc	3.253.968	1,60
317.136	Prudential plc	5.287.469	2,59
65.460	Rio Tinto plc	3.114.334	1,53
270.523	Royal Dutch Shell plc - B	7.326.580	3,59
279.475	St James's Place plc	3.093.950	1,52
1.518.259	Tesco plc	4.135.930	2,03
36.491	Unilever plc	2.016.995	0,99
2.448.664	Vodafone Group plc	4.483.885	2,20
85.319	Weir Group plc	1.374.748	0,67
Total del Reino Unido		45.858.943	22,49
Total de renta variable		202.643.809	99,46
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		202.643.809	99,46

Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios

Fondos

IRLANDA

44	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	4.388	0,00
Total de Irlanda		4.388	0,00
Total de fondos		4.388	0,00
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		4.388	0,00
Valor total de las inversiones		202.648.197	99,46

(Coste total: EUR 184.061.144)

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BÉLGICA				NORUEGA			
21.759	KBC Group NV	1.297.272	2,30	83.979	Dnb ASA	1.358.600	2,40
	Total de Bélgica	1.297.272	2,30	62.027	Mowi ASA	1.314.367	2,33
DINAMARCA				Total de Noruega		2.672.967	4,73
61.554	Tryg A/S	1.618.344	2,87	ESPAÑA			
	Total de Dinamarca	1.618.344	2,87	19.048	Amadeus IT Holding SA - A	1.251.835	2,22
FINLANDIA				22.192	Industria de Diseno Textil SA	630.253	1,12
18.787	Kone Oyj	981.433	1,74	Total de España		1.882.088	3,34
19.017	Neste Oyj	577.546	1,02	SUECIA			
62.349	Sampo Oyj - A	2.274.491	4,04	61.754	Atlas Copco AB	1.537.077	2,72
	Total de Finlandia	3.833.470	6,80	Total de Suecia		1.537.077	2,72
FRANCIA				SUIZA			
11.048	Air Liquide SA	1.442.869	2,56	18.267	Julius Baer Group Limited	743.052	1,32
13.014	Nexity SA	568.452	1,01	997	Partners Group Holding		
4.960	Pernod-Ricard SA	810.464	1,44		AG - Reg	702.334	1,24
21.148	Sanofi	1.798.849	3,19	337	SGS SA - Reg	766.943	1,36
16.305	Schneider Electric SE	1.312.553	2,33	Total de Suiza		2.212.329	3,92
28.674	Total SA	1.373.054	2,43	REINO UNIDO			
	Total de Francia	7.306.241	12,96	23.927	Astrazeneca plc	1.963.789	3,48
ALEMANIA				125.855	BBA Aviation plc	444.134	0,79
4.143	Adidas AG	1.183.448	2,10	17.406	Carnival plc	663.039	1,17
7.533	Allianz SE - Reg	1.610.932	2,85	36.987	Diageo plc	1.393.461	2,46
93.065	Deutsche Telekom AG - Reg	1.432.643	2,54	270.995	DS Smith plc	1.103.968	1,96
9.745	Knorr-Bremse AG	840.409	1,49	154.230	Glaxosmithkline plc	3.041.409	5,38
23.456	Vonovia SE	1.091.877	1,93	338.441	Legal & General Group plc	950.265	1,68
	Total de Alemania	6.159.309	10,91	44.471	Persimmon plc	1.090.804	1,93
ITALIA				18.507	Rio Tinto plc	880.492	1,56
67.210	Fincobank Banca Fineco SpA	652.744	1,16	88.672	Royal Dutch Shell plc - A	2.389.478	4,24
74.495	Marr SpA	1.497.350	2,65	109.335	St James's Place plc	1.210.402	2,14
169.881	Pirelli & Company SpA	922.114	1,63	857.040	Vodafone Group plc	1.569.373	2,78
347.716	Snam SpA	1.611.316	2,85	Total del Reino Unido		16.700.614	29,57
	Total de Italia	4.683.524	8,29	Total de renta variable		55.980.365	99,18
PAÍSES BAJOS				Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		55.980.365	99,18
40.736	Philips NV	1.731.280	3,07	Valor total de las inversiones		55.980.365	99,18
91.940	RELX plc	2.007.049	3,56	(Coste total: EUR 53.590.465)			
42.408	Unilever NV	2.338.801	4,14				
	Total de los Países Bajos	6.077.130	10,77				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRIA				ALEMANIA (continuación)			
43.551	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	2.373.530	0,44	189.636	Stabilus SA	8.514.656	1,56
				102.375	STRATEC SE	7.350.525	1,35
	Total de Austria	2.373.530	0,44	215.729	TeamViewer AG	5.326.349	0,98
BÉLGICA				882.304	Tele Columbus AG	1.554.620	0,29
105.192	Biocartis NV	652.190	0,12	29.229	Varta AG	2.645.225	0,49
144.185	Melexis NV	9.162.956	1,69		Total de Alemania	66.102.256	12,17
210.117	Umicore SA	7.276.352	1,34	ISLANDIA			
770.047	X-Fab Silicon Foundries SE	3.157.193	0,58	738.708	Marel HF	3.102.574	0,57
	Total de Bélgica	20.248.691	3,73		Total de Islandia	3.102.574	0,57
DINAMARCA				IRLANDA			
34.920	Christian Hansen Holding A/S	2.719.215	0,50	1.239.024	Dalata Hotel Group Limited	6.071.218	1,12
117.108	Simcorp A/S	9.434.447	1,73	1.572.493	Irish Continental Group plc	6.573.020	1,21
	Total de Dinamarca	12.153.662	2,23	178.735	Kingspan Group plc	8.018.052	1,47
FINLANDIA					Total de Irlanda	20.662.290	3,80
109.273	Basware Oyj	2.404.006	0,44	ITALIA			
88.184	Cargotec Oyj	2.603.192	0,48	645.455	Carel Industries SpA	8.765.279	1,61
233.854	Huhtamaki Oyj	8.554.379	1,57	100.566	Diasorin SpA	10.730.393	1,97
166.284	Konecranes Oyj	4.892.076	0,90	1.085.021	Finecobank Banca Fineco SpA	10.537.724	1,94
285.606	Tikkurila Oyj	3.867.105	0,71	22.192	Industria Macchine Automatiche SpA	1.424.726	0,26
172.370	Vaisala Oyj	4.369.580	0,80	580.664	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	5.527.921	1,02
	Total de Finlandia	26.690.338	4,90	388.318	Marr SpA	7.805.192	1,44
FRANCIA				1.557.659	Pirelli & Company SpA	8.454.974	1,56
260.095	Bureau Veritas SA	5.748.100	1,06		Total de Italia	53.246.209	9,80
91.853	Edenred	4.044.288	0,74	JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
663.057	Elis SA	10.754.784	1,98	689.852	JTC plc	2.736.991	0,50
291.163	Lectra	5.270.050	0,97		Total de Jersey - Islas del Canal	2.736.991	0,50
138.371	Nexity SA	6.044.045	1,11	LUXEMBURGO			
102.027	Orpea	11.437.227	2,10	29.172	Eurofins Scientific	12.438.941	2,29
52.969	SEB SA	7.378.582	1,36		Total de Luxemburgo	12.438.941	2,29
14.078	Teleperformance	2.800.114	0,51	PAÍSES BAJOS			
	Total de Francia	53.477.190	9,83	103.254	IMCD Group NV	7.005.784	1,29
ALEMANIA				35.974	Interxion Holding NV	2.687.986	0,49
91.316	Brenntag AG	4.054.430	0,75	98.853	Sligro Food Group NV	2.565.235	0,47
74.261	Compugroup Holding AG	4.099.207	0,75	126.157	Takeaway.com Holding BV	9.234.692	1,70
176.856	CTS Eventim AG	9.143.455	1,69		Total de los Países Bajos	21.493.697	3,95
85.585	Gerresheimer AG	5.631.493	1,04				
79.877	Grenke AG	6.038.701	1,11				
243.103	Norma Group	7.735.537	1,42				
23.943	Sartorius AG	4.008.058	0,74				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)				Renta variable (continuación)			
ESPAÑA				REINO UNIDO (continuación)			
440.566	Applus Services SA	5.242.735	0,96	805.353	Victoria plc	4.451.490	0,82
518.362	Fluidra SA	5.639.779	1,04	297.397	Victrex plc	7.254.347	1,33
	Total de España	10.882.514	2,00		Total del Reino Unido	137.635.431	25,31
SUECIA				Total de renta variable			
497.495	Avanza Bank Holding AB	3.722.269	0,68		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	537.128.179	98,79
836.632	Dometic Group AB	6.027.107	1,11				
597.486	Elektro AB - B	7.229.568	1,33		Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario		
753.903	Hexpol AB	5.313.670	0,98		Renta variable		
1.758.633	Karnov Group AB	7.875.191	1,45		DINAMARCA		
154.896	MIPS AB	2.413.245	0,44	49.761	Ow Bunker A/S	0	0,00
198.909	Stillfront Group AB	4.806.167	0,88		Total de Dinamarca	0	0,00
140.235	Thule Group AB	2.438.636	0,45		Total de renta variable	0	0,00
	Total de Suecia	39.825.853	7,32		Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	0	0,00
SUIZA					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
1.598	Belimo Holding AG - Reg	8.070.165	1,49		Fondos		
18.797	Burckhardt Compression Holding AG	4.322.767	0,80		IRLANDA		
6.234	LEM Holding SA	6.824.126	1,25	97	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	9.702	0,00
861.455	SIG Combibloc Group AG	10.539.439	1,93		Total de Irlanda	9.702	0,00
20.153	Sika AG	2.706.611	0,50		Total de fondos	9.702	0,00
87.483	Vat Group AG	10.127.684	1,86		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	9.702	0,00
41.832	VZ Holding AG	11.467.220	2,12		Valor total de las inversiones	537.137.881	98,79
	Total de Suiza	54.058.012	9,95		(Coste total: EUR 472.651.540)		
REINO UNIDO							
1.541.012	Ascential plc	6.601.695	1,21				
164.541	Aveva Group plc	6.881.547	1,27				
2.545.650	BBA Aviation plc	8.983.423	1,65				
729.798	Big Yellow Group plc	8.570.940	1,58				
6.181.092	Coats Group plc	5.194.652	0,96				
722.500	Cvs Group plc	8.330.063	1,53				
156.759	First Derivatives plc	3.960.229	0,73				
383.027	Genus plc	12.088.017	2,22				
440.467	GlobalData plc	4.132.394	0,76				
1.359.137	Howden Joinery Group plc	8.609.374	1,58				
1.848.732	Ibstock plc	4.935.874	0,91				
5.795.301	Johnson Service Group plc	11.398.179	2,10				
490.632	Just Eat plc	3.705.720	0,68				
1.619.255	Rentokil Initial plc	8.562.207	1,57				
1.344.117	Rightmove PLC	8.365.339	1,54				
568.065	St James's Place plc	6.288.809	1,16				
1.160.353	Synthomer plc	4.254.820	0,78				
1.859.793	Tyman plc	5.066.312	0,93				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRIA				ALEMANIA (continuación)			
123.439	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	6.727.426	0,58	117.529	Sartorius AG	19.674.354	1,70
	Total de Austria	6.727.426	0,58	345.490	Stabilus SA	15.512.501	1,34
BÉLGICA				148.175	STRATEC SE	10.638.965	0,92
289.991	Biocartis NV	1.797.944	0,15	453.756	TeamViewer AG	11.203.236	0,96
42.620	Telenet Group Holding NV	1.845.446	0,16	2.423.382	Tele Columbus AG	4.269.999	0,37
572.831	Umicore SA	19.837.138	1,71	62.720	Varta AG	5.676.160	0,49
1.723.432	X-Fab Silicon Foundries SE	7.066.071	0,61		Total de Alemania	202.810.469	17,46
	Total de Bélgica	30.546.599	2,63	ISLANDIA			
DINAMARCA				1.573.143	Marel HF	6.607.201	0,57
75.504	Christian Hansen Holding A/S	5.879.485	0,51		Total de Islandia	6.607.201	0,57
242.862	Simcorp A/S	19.565.433	1,69	IRLANDA			
414.453	Tryg A/S	10.896.571	0,94	3.587.878	Dalata Hotel Group Limited	17.580.602	1,51
	Total de Dinamarca	36.341.489	3,14	3.505.061	Irish Continental Group plc	14.651.155	1,26
FINLANDIA				473.048	Kingspan Group plc	21.220.933	1,83
370.119	Cargotec Oyj	10.925.913	0,94		Total de Irlanda	53.452.690	4,60
508.811	Huhtamaki Oyj	18.612.307	1,60	ITALIA			
446.264	Konecranes Oyj	13.129.087	1,13	685.720	Davide Campari-Milano SpA	5.684.619	0,49
	Total de Finlandia	42.667.307	3,67	234.327	Diasorin SpA	25.002.691	2,15
FRANCIA				2.303.814	Fincobank Banca Fineco SpA	22.374.642	1,93
733.258	Bureau Veritas SA	16.205.002	1,40	120.902	Industria Macchine Automatiche SpA	7.761.908	0,67
244.627	Edenred	10.770.927	0,93	1.857.403	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	17.682.477	1,52
1.572.388	Elis SA	25.504.132	2,19	754.326	Marr SpA	15.161.953	1,31
166.902	Ingenico Group SA	14.937.729	1,29	332.347	Salvatore Ferragamo Italia SpA	5.634.943	0,49
177.436	Korian SA	6.692.886	0,58		Total de Italia	99.303.233	8,56
294.966	Nexity SA	12.884.115	1,11	JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
227.898	Orpea	25.547.366	2,20	973.894	Sanne Group plc	5.977.530	0,51
112.660	SEB SA	15.693.538	1,35		Total de Jersey - Islas del Canal	5.977.530	0,51
42.866	Teleperformance	8.526.047	0,73	LUXEMBURGO			
167.876	Ubisoft Entertainment	11.136.894	0,96	62.842	Eurofins Scientific	26.795.829	2,30
	Total de Francia	147.898.636	12,74		Total de Luxemburgo	26.795.829	2,30
ALEMANIA				PAÍSES BAJOS			
277.694	Brenntag AG	12.329.614	1,06	291.508	IMCD Group NV	19.778.817	1,69
420.871	Cancom SE	20.833.115	1,79	320.733	Takeaway.com Holding BV	23.477.656	2,02
313.319	Compugroup Holding AG	17.295.209	1,49		Total de los Países Bajos	43.256.473	3,71
535.722	CTS Eventim AG	27.696.828	2,38				
185.508	Gerresheimer AG	12.206.426	1,05				
226.032	Grenke AG	17.088.019	1,47				
449.173	Norma Group	14.292.685	1,23				
198.498	Puma SE	14.093.358	1,21				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
ESPAÑA				IRLANDA			
1.382.710	Applus Services SA	16.454.249	1,42	142	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	14.148	0,00
1.112.921	Fluidra SA	12.108.580	1,04				
	Total de España	28.562.829	2,46		Total de Irlanda	14.148	0,00
SUECIA				Total de fondos			
1.793.654	Avanza Bank Holding AB	13.420.160	1,16		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	14.148	0,00
2.326.302	Dometic Group AB	16.758.709	1,44		Valor total de las inversiones	1.156.736.469	99,61
541.125	Intrum AB	12.489.411	1,08		(Coste total: EUR 1.152.728.938)		
352.930	Thule Group AB	6.137.325	0,53				
	Total de Suecia	48.805.605	4,21				
SUIZA							
3.982	Belimo Holding AG - Reg	20.109.759	1,73				
1.935.106	SIG Combibloc Group AG	23.674.982	2,03				
188.050	Sika AG	25.255.703	2,17				
	Total de Suiza	69.040.444	5,93				
REINO UNIDO							
4.897.326	Ascential plc	20.980.144	1,81				
226.059	Ashtead Group plc	5.785.068	0,50				
520.254	Aveva Group plc	21.758.422	1,88				
5.895.177	BBA Aviation plc	20.803.672	1,79				
1.485.759	Big Yellow Group plc	17.449.146	1,50				
13.836.567	Coats Group plc	11.628.390	1,00				
1.188.719	Cvs Group plc	13.705.334	1,18				
183.671	Derwent London plc	6.996.498	0,60				
3.764.328	DS Smith plc	15.334.954	1,32				
5.950.350	Elementis plc	9.947.660	0,86				
335.195	First Derivatives plc	8.468.087	0,73				
910.401	Genus plc	28.731.506	2,47				
3.656.463	Howden Joinery Group plc	23.161.653	2,00				
4.479.883	Ibstock plc	11.960.706	1,03				
1.085.878	Just Eat plc	8.201.584	0,71				
267.007	Renishaw plc	11.058.300	0,95				
3.330.057	Rentokil Initial plc	17.608.491	1,52				
1.096.714	Shaftesbury plc	11.262.338	0,97				
1.759.822	St James's Place plc	19.482.249	1,68				
2.712.815	Synthomer plc	9.947.439	0,86				
559.875	Victrex plc	13.656.920	1,18				
	Total del Reino Unido	307.928.561	26,54				
Total de renta variable		1.156.722.321	99,61				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		1.156.722.321	99,61				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Select

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
DINAMARCA				PAÍSES BAJOS			
99.242	Christian Hansen Holding A/S	7.727.959	0,54	211.060	ASML Holding NV	47.963.385	3,34
408.778	DSV A/S	35.685.858	2,48	747.351	IMCD Group NV	50.707.765	3,53
1.049.193	Novo-Nordisk A/S	49.485.429	3,44	292.087	Interxion Holding NV	21.824.809	1,52
	Total de Dinamarca	92.899.246	6,46	1.042.083	Philips NV	44.288.527	3,09
FINLANDIA				3.261.945	RELX plc	71.208.259	4,96
552.404	Kone Oyj	28.857.585	2,01	788.772	Unilever NV	43.500.776	3,03
1.440.348	Sampo Oyj - A	52.543.895	3,66		Total de los Países Bajos	279.493.521	19,47
	Total de Finlandia	81.401.480	5,67	ESPAÑA			
FRANCIA				759.177	Amadeus IT Holding SA - A	49.893.112	3,47
190.671	Air Liquide SA	24.901.633	1,73	2.396.994	Grifols SA - ADR	44.061.420	3,07
435.524	Dassault Systemes SA	56.944.764	3,97	1.064.577	Industria de Diseno Textil SA	30.233.987	2,10
2.632.485	Elis SA	42.698.907	2,97		Total de España	124.188.519	8,64
310.172	EssilorLuxottica SA	41.020.247	2,86	SUECIA			
474.121	Legrand SA	31.045.443	2,16	908.537	Assa Abloy AB	18.570.759	1,29
270.091	L'Oreal SA	69.386.378	4,83	1.270.460	Atlas Copco AB - A	35.936.424	2,50
110.787	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	40.398.480	2,81	1.913.213	Epiroc AB - A	19.044.625	1,33
456.469	Pernod-Ricard SA	74.587.035	5,19	1.107.400	Sandvik AB	15.842.837	1,10
266.330	Schneider Electric SE	21.439.565	1,49		Total de Suecia	89.394.645	6,22
211.507	Ubisoft Entertainment	14.031.374	0,98	SUIZA			
	Total de Francia	416.453.826	28,99	295.777	Nestle SA - Reg	29.460.894	2,05
ALEMANIA				223.890	Sika AG	30.069.127	2,09
179.058	Adidas AG	51.147.917	3,56		Total de Suiza	59.530.021	4,14
1.146.952	Brenntag AG	50.924.669	3,55	Total de renta variable			
485.959	Fresenius Medical Care AG & Company KGaA	29.983.670	2,09		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.400.534.301	97,49
321.455	Knorr-Bremse AG	27.722.279	1,93	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
1.632.390	Tele Columbus AG	2.876.271	0,20	Fondos			
	Total de Alemania	162.654.806	11,33	IRLANDA			
IRLANDA				184.121	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	18.365.303	1,28
136.821	Kerry Group plc	14.680.893	1,02		Total de Irlanda	18.365.303	1,28
318.139	Kingspan Group plc	14.252.627	0,99	Total de fondos			
	Total de Irlanda	28.933.520	2,01		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	18.365.303	1,28
ITALIA				Valor total de las inversiones			
4.558.169	Davide Campari-Milano SpA	37.787.221	2,63		1.418.899.604	98,77	
861.266	Finecobank Banca Fineco SpA	8.364.615	0,58	(Coste total: EUR 1.260.223.430)			
2.041.269	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	19.432.881	1,35				
	Total de Italia	65.584.717	4,56				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRIA				ALEMANIA (continuación)			
162.937	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	8.880.067	0,50	359.627	Grenke AG	27.187.801	1,52
	Total de Austria	8.880.067	0,50	335.333	Knorr-Bremse AG	28.919.118	1,61
BÉLGICA				913.608	Norma Group	29.071.007	1,62
361.169	Biocartis NV	2.239.248	0,12	258.197	Sartorius AG	43.222.177	2,42
586.088	Melexis NV	37.245.892	2,07	595.328	Stabilus SA	26.730.227	1,49
66.058	Telenet Group Holding NV	2.860.311	0,16	371.659	STRATEC SE	26.685.116	1,49
883.841	Umicore SA	30.607.414	1,71	703.896	TeamViewer AG	17.379.192	0,97
3.137.056	X-Fab Silicon Foundries SE	12.861.930	0,72	3.445.614	Tele Columbus AG	6.071.172	0,34
	Total de Bélgica	85.814.795	4,78	96.954	Varta AG	8.774.337	0,49
DINAMARCA					Total de Alemania	347.641.128	19,40
216.770	Christian Hansen Holding A/S	16.879.846	0,94	ISLANDIA			
472.716	Simcorp A/S	38.082.917	2,12	2.425.033	Marel HF	10.185.139	0,57
941.311	Tryg A/S	24.748.433	1,38		Total de Islandia	10.185.139	0,57
	Total de Dinamarca	79.711.196	4,44	IRLANDA			
FINLANDIA				5.472.107	Dalata Hotel Group Limited	26.813.324	1,49
470.378	Basware Oyj	10.348.316	0,58	6.151.937	Irish Continental Group plc	25.715.096	1,44
756.438	Cargotec Oyj	22.330.050	1,24	1.016.259	Kingspan Group plc	45.589.379	2,54
903.374	Huhtamaki Oyj	33.045.421	1,84		Total de Irlanda	98.117.799	5,47
887.385	Konecranes Oyj	26.106.866	1,46	ITALIA			
1.078.052	Tikkurila Oyj	14.596.824	0,81	2.153.523	Davide Campari-Milano SpA	17.852.706	1,00
511.902	Vaisala Oyj	12.976.716	0,72	429.776	Diasorin SpA	45.857.100	2,56
	Total de Finlandia	119.404.193	6,65	3.864.308	Finecobank Banca Fineco SpA	37.530.159	2,09
FRANCIA				132.483	Industria Macchine Automatiche SpA	8.505.409	0,47
1.607.275	Bureau Veritas SA	35.520.778	1,98	4.356.967	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	41.478.326	2,31
431.934	Edenred	19.018.054	1,06	1.824.877	Marr SpA	36.680.028	2,04
2.560.786	Elis SA	41.535.949	2,31	6.407.972	Pirelli & Company SpA	34.782.472	1,94
277.707	Korian SA	10.475.108	0,58		Total de Italia	222.686.200	12,41
785.108	Nexity SA	34.293.517	1,91	LUXEMBURGO			
380.748	Orpea	42.681.850	2,38	98.354	Eurofins Scientific	41.938.146	2,34
193.427	Remy Cointreau	23.559.408	1,31		Total de Luxemburgo	41.938.146	2,34
217.148	SEB SA	30.248.716	1,69	PAÍSES BAJOS			
62.250	Teleperformance	12.381.525	0,69	573.733	IMCD Group NV	38.927.784	2,17
259.645	Ubisoft Entertainment	17.224.849	0,96	559.499	Interxion Holding NV	41.805.897	2,33
	Total de Francia	266.939.754	14,87	326.659	Sligro Food Group NV	8.476.801	0,47
ALEMANIA				545.299	Takeaway.com Holding BV	39.915.887	2,23
718.488	Brenntag AG	31.900.867	1,78		Total de los Países Bajos	129.126.369	7,20
600.326	Compugroup Holding AG	33.137.995	1,85				
903.189	CTS Eventim AG	46.694.871	2,60				
332.329	Gerresheimer AG	21.867.248	1,22				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
ESPAÑA				IRLANDA			
2.449.874	Applus Services SA	29.153.501	1,63	206	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	20.583	0,00
1.828.906	Fluidra SA	19.898.497	1,11				
	Total de España	49.051.998	2,74		Total de Irlanda	20.583	0,00
SUECIA					Total de fondos	20.583	0,00
2.783.091	Avanza Bank Holding AB	20.823.151	1,16		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	20.583	0,00
3.945.862	Dometic Group AB	28.426.040	1,58		Valor total de las inversiones	1.790.446.869	99,81
2.169.313	Elekta AB - B	26.248.643	1,46				
2.486.142	Hexpol AB	17.522.863	0,98				
584.935	Thule Group AB	10.171.809	0,57				
	Total de Suecia	103.192.506	5,75				
SUIZA							
8.696	Belimo Holding AG - Reg	43.916.239	2,45				
84.355	Burckhardt Compression Holding AG	19.399.213	1,08				
24.991	LEM Holding SA	27.356.710	1,52				
3.161.191	SIG Combibloc Group AG	38.675.474	2,15				
330.200	Sika AG	44.346.892	2,47				
304.581	Vat Group AG	35.260.567	1,97				
	Total de Suiza	208.955.095	11,64				
ESTADOS UNIDOS							
262.482	Autoliv Inc.	18.781.901	1,05				
	Total de Estados Unidos	18.781.901	1,05				
	Total de renta variable	1.790.426.286	99,81				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	1.790.426.286	99,81				
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario							
Renta variable							
DINAMARCA							
280.528	Ow Bunker A/S	0	0,00				
	Total de Dinamarca	0	0,00				
	Total de renta variable	0	0,00				
	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario	0	0,00				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				INDIA (continuación)			
73.063	Australia & New Zealand Banking Group Limited	1.405.390	2,40	83.860	Infosys Technologies Limited - ADR	953.488	1,64
84.314	BHP Group Limited	2.088.104	3,59	408.876	Petronet Lng Limited	1.499.532	2,57
108.010	Dexus	869.069	1,49	Total de India		4.944.299	8,50
112.975	Fortescue Metals Group Limited	670.525	1,15	INDONESIA			
107.351	Lendlease Group	1.271.395	2,18	4.071.200	Bank Rakyat Indonesia	1.181.682	2,03
18.320	Macquarie Group Limited	1.619.615	2,78	5.269.100	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	1.599.907	2,75
127.938	Oz Minerals Limited	829.226	1,42	Total de Indonesia		2.781.589	4,78
184.572	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	999.611	1,72	MACAO			
151.360	Transurban Group	1.499.625	2,57	430.400	Wynn Macao Limited	840.004	1,44
Total de Australia		11.252.560	19,30	Total de Macao		840.004	1,44
ISLAS CAIMÁN				FILIPINAS			
1.492.000	China Resources Cement Holdings Limited	1.495.923	2,57	969.520	Ayala Land Inc.	925.008	1,59
306.000	China Resources Land Limited	1.282.255	2,19	Total de Filipinas		925.008	1,59
358.800	Sands China Limited	1.624.796	2,79	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
Total de las Islas Caimán		4.402.974	7,55	24.321	KB Financial Group Inc.	868.212	1,49
CHINA				25.443	Orange Life Insurance Limited	575.377	0,99
1.589.000	China Construction Bank Corp.	1.212.113	2,08	124.852	Samsung Electronics Company Limited Pfd	4.122.961	7,06
233.000	China Merchants Bank Company Limited - H	1.108.620	1,90	4.783	SK Innovation Company Limited P.P. 144A	663.781	1,14
170.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.958.511	3,36	Total de la República de Corea (Sur)		6.230.331	10,68
70.100	Wuliangye Yibin Company Limited	1.274.148	2,19	SINGAPUR			
Total de China		5.553.392	9,53	369.000	Capitaland Limited	941.912	1,62
HONG KONG				469.300	Lendlease Global Commercial REIT	298.636	0,51
228.000	Aia Group Limited	2.153.663	3,69	532.400	Mapletree Commercial Trust	881.623	1,51
135.500	China Mobile Limited	1.120.901	1,92	73.200	United Overseas Bank Limited	1.358.241	2,33
882.000	Cnooc Limited	1.345.605	2,31	Total de Singapur		3.480.412	5,97
29.927	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	878.029	1,51	TAIWÁN			
72.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.043.194	1,79	238.000	Chroma ATE Inc.	1.127.704	1,93
768.000	Xinyi Glass Holdings Limited	845.454	1,45	163.000	MediaTek Inc.	1.938.718	3,33
Total de Hong Kong		7.386.846	12,67	428.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.752.437	6,44
INDIA				157.000	Yageo Corp.	1.247.433	2,15
265.200	Embassy Office Parks REIT	1.502.657	2,59	Total de Taiwán		8.066.292	13,85
57.078	HDFC Bank Limited	988.622	1,70				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
TAILANDIA			
1.164.200	Samui Airport Property Fund	980.166	1,68
318.000	Thai Oil plc	725.214	1,24
Total de Tailandia		1.705.380	2,92
Total de renta variable		57.569.087	98,78
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		57.569.087	98,78
Valor total de las inversiones		57.569.087	98,78
(Coste total: USD 52.714.504)			

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BERMUDAS				ESTADOS UNIDOS (continuación)			
54.500	Genpact Limited	2.111.875	0,80	8.850	Alphabet Inc. - A	10.807.089	4,12
365.003	Marvell Technology Group Limited	9.114.125	3,47	6.402	Alphabet Inc. - C	7.804.038	2,97
	Total de Bermudas	11.226.000	4,27	55.604	Apple Inc.	12.453.628	4,75
BRASIL				158.400	Applied Materials Inc.	7.904.160	3,01
135.867	Linx SA	1.050.252	0,40	14.200	Arista Networks Inc.	3.392.664	1,29
	Total de Brasil	1.050.252	0,40	830	Booking Holdings Inc.	1.628.966	0,62
ISLAS CAIMÁN				48.080	Broadcom Inc.	13.273.446	5,06
62.535	Afya Limited	1.603.397	0,61	48.700	CommScope Holding Company Inc.	572.712	0,22
91.300	Cambium Networks Corp	885.610	0,34	26.255	Cornerstone OnDemand Inc.	1.439.299	0,55
55.532	Pagseguro Digital Limited	2.571.687	0,98	36.600	Dell Technologies Inc. - C	1.898.076	0,72
32.399	Smart Global Holdings Inc.	825.527	0,31	71.546	Dxc Technology Company	2.110.607	0,81
17.900	Tencent Holdings Limited	745.177	0,28	7.288	Euronet Worldwide Inc.	1.066.234	0,41
	Total de las Islas Caimán	6.631.398	2,52	2.100	F5 Networks Inc.	294.882	0,11
ALEMANIA				34.100	Fidelity National Information Services Inc.	4.527.116	1,72
305.500	Infineon Technologies AG	5.499.422	2,09	32.700	Fiserv Inc.	3.387.393	1,29
40.957	TeamViewer AG	1.102.441	0,42	29.924	ForeScout Technologies Inc.	1.134.718	0,43
	Total de Alemania	6.601.863	2,51	69.858	Fortinet Inc.	5.362.300	2,04
ISRAEL				16.283	Global Payments Inc.	2.588.997	0,98
35.600	Mellanox Technologies Limited	3.901.404	1,49	22.592	Godaddy Inc.	1.490.620	0,57
	Total de Israel	3.901.404	1,49	47.037	Inphi Corp.	2.871.609	1,09
PAÍSES BAJOS				79.031	Lam Research Corp.	18.264.853	6,96
48.100	NXP Semiconductor NV	5.248.672	2,00	36.999	Logmein Inc.	2.625.449	1,00
	Total de los Países Bajos	5.248.672	2,00	204.811	Micron Technology Inc.	8.776.151	3,34
SUIZA				59.900	Microsoft Corp.	8.327.897	3,16
9.109	Logitech International SA - Reg	369.786	0,14	3.600	Mks Instruments Inc.	332.208	0,13
	Total de Suiza	369.786	0,14	112.500	NetApp Inc.	5.907.375	2,25
REINO UNIDO				465.150	Nuance Communications Inc.	7.586.597	2,89
1.074.484	Finabl plc	2.052.334	0,78	330.112	On Semiconductor Corp.	6.341.452	2,41
	Total del Reino Unido	2.052.334	0,78	86.700	Oracle Corp.	4.771.101	1,82
ESTADOS UNIDOS				22.800	Palo Alto Networks Inc.	4.647.324	1,77
80.754	Activision Blizzard Inc.	4.273.502	1,63	26.236	Ping Identity Holding Corp	452.571	0,17
39.100	Advanced Energy Industries Inc.	2.244.731	0,85	16.200	Plantronics Inc.	604.584	0,23
				45.305	Qorvo Inc.	3.358.913	1,28
				53.175	Sailpoint Technologies Holding Inc.	993.841	0,38
				27.572	Salesforce.com Inc.	4.092.788	1,56
				58.702	Sciplay Corp. - A	628.111	0,24
				10.700	Splunk Inc.	1.261.102	0,48
				111.000	Symantec Corp.	2.622.930	1,00
				119.884	Synaptics Inc.	4.789.366	1,82
				82.390	Synopsys Inc.	11.308.028	4,30
				150.768	Teradyne Inc.	8.730.975	3,32
				233.850	Tivo Corp.	1.780.768	0,68
				33.400	Verint Systems Inc.	1.428.852	0,54
				53.700	Visa Inc. - A	9.236.937	3,52

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
111.000	Western Digital Corp.	6.620.040	2,52
66.370	Xperi Corp.	1.372.532	0,52
	Total de Estados Unidos	219.389.532	83,53
	Total de renta variable	256.471.241	97,64
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	256.471.241	97,64
	Valor total de las inversiones	256.471.241	97,64
(Coste total: USD 225.014.945)			

Threadneedle (Lux) - UK Equities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado en GBP	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado en GBP	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
IRLANDA				REINO UNIDO (continuación)			
132.611	CRH plc	3.697.195	1,39	571.261	Prudential plc	8.426.100	3,18
	Total de Irlanda	3.697.195	1,39	133.859	Reckitt Benckiser Group plc	8.492.015	3,21
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				435.947	RELX plc	8.424.676	3,19
3.599.144	Breedon Group plc	2.350.241	0,89	674.798	Rentokil Initial plc	3.156.705	1,19
59.909	Ferguson plc	3.560.991	1,34	206.636	Rio Tinto plc	8.697.309	3,29
	Total de Jersey - Islas del Canal	5.911.232	2,23	463.583	Rolls-Royce Holdings plc	3.673.432	1,39
REINO UNIDO				781.931	Rotork plc	2.435.715	0,92
201.719	Aggreko plc	1.675.881	0,63	588.416	Royal Dutch Shell plc - B	14.098.447	5,33
212.125	Associated British Foods plc	4.885.239	1,85	581.408	Royal Mail plc	1.230.841	0,47
3.148.255	Barclays plc	4.734.976	1,79	433.800	RSA Insurance Group	2.317.360	0,88
47.533	Berkeley Group Holdings plc	1.986.404	0,75	683.754	Sage Group plc	4.727.475	1,79
295.675	British American Tobacco plc	8.892.425	3,36	96.905	Schroders plc	2.349.946	0,89
3.132.118	BT Group plc	5.593.336	2,11	270.109	Smith & Nephew plc	5.291.435	2,00
98.270	Burberry Group plc	2.136.390	0,81	232.658	Smiths Group plc	3.652.731	1,38
124.206	Carnival plc	4.185.742	1,58	197.485	SSP Group plc	1.224.407	0,46
2.095.860	Cobham plc	3.287.356	1,24	404.692	St James's Place plc	3.963.553	1,50
274.684	Compass Group	5.749.136	2,17	1.168.035	Stagecoach Group plc	1.561.663	0,59
736.077	Crest Nicholson Holdings plc	2.789.732	1,05	760.461	Standard Chartered plc	5.203.074	1,97
65.599	Derwent London plc	2.210.686	0,84	2.330.571	Tesco plc	5.616.676	2,11
305.114	Diageo plc	10.169.450	3,84	172.659	Unilever plc	8.443.025	3,19
951.630	DS Smith plc	3.429.675	1,30	353.076	Weir Group plc	5.033.098	1,90
277.167	Easyjet plc	3.187.420	1,20	89.772	Whitbread plc	3.854.810	1,46
820.064	Elementis plc	1.212.875	0,46		Total del Reino Unido	254.385.184	96,13
77.717	Euromoney Institutional Investor plc	1.150.212	0,43		Total de renta variable	263.993.611	99,75
226.056	Fdm Group Holdings plc	1.670.554	0,63		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	263.993.611	99,75
785.246	Glaxosmithkline plc	13.699.402	5,18		Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		
1.234.445	Grainger plc	3.036.735	1,15		Fondos		
237.362	Greene King plc	2.010.456	0,76		IRLANDA		
513.885	Howden Joinery Group plc	2.879.812	1,09	77.677	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	77.677	0,03
458.078	Hunting plc	2.099.830	0,79		Total de Irlanda	77.677	0,03
243.970	Imperial Brands plc	4.460.260	1,69		Total de fondos	77.677	0,03
316.984	Inchcape plc	2.001.754	0,76		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	77.677	0,03
634.069	Informa plc	5.402.268	2,04		Valor total de las inversiones	264.071.288	99,78
79.515	InterContinental Hotels Group plc	4.035.386	1,52		(Coste total: GBP 258.532.776)		
305.529	Intermediate Capital Group plc	4.445.447	1,68				
4.358.423	ITV plc	5.487.254	2,07				
743.295	John Wood Group plc	2.823.777	1,07				
190.429	Johnson Matthey plc	5.821.414	2,20				
282.932	Land Securities Group plc	2.423.030	0,91				
1.756.950	Legal & General Group plc	4.364.264	1,65				
74.541	London Stock Exchange Group plc	5.447.456	2,06				
1.549.929	Melrose Industries plc	3.124.657	1,18				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado en GBP	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
Renta variable			
GUERNSEY - ISLAS DEL CANAL			
2.136.113	Sherborne Investors Guernsey C	1.089.418	0,61
1.288.866	Sherborne Investors Guernsey B	103.109	0,06
	Total de Guernsey - Islas del Canal	1.192.527	0,67
JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
52.185	Ferguson plc	3.101.876	1,75
	Total de Jersey - Islas del Canal	3.101.876	1,75
REINO UNIDO			
482.490	3i Group plc	5.628.246	3,18
219.620	Astrazeneca plc	15.946.607	8,99
802.534	BAE Systems plc	4.574.444	2,58
2.398.283	BT Group plc	4.282.854	2,42
2.586.056	Centrica plc	1.906.958	1,08
635.642	Chesnara plc	1.789.332	1,01
2.805.174	Cobham plc	4.399.915	2,48
210.785	Compass Group	4.411.730	2,49
868.047	DS Smith plc	3.128.441	1,77
1.221.241	Electrocomponents plc	7.862.350	4,43
780.183	Elementis plc	1.153.891	0,65
653.842	Glaxosmithkline plc	11.406.928	6,44
75.918	Go-Ahead Group plc	1.528.989	0,86
1.706.520	Hays plc	2.573.432	1,45
156.185	Imi plc	1.499.688	0,85
339.096	Imperial Brands plc	6.199.353	3,50
2.930.316	ITV plc	3.689.268	2,08
193.478	JD Wetherspoon plc	2.998.909	1,69
115.024	Johnson Matthey plc	3.516.283	1,99
1.701.887	Legal & General Group plc	4.227.487	2,39
1.960.162	Marks & Spencer Group plc	3.615.519	2,04
1.474.134	Melrose Industries plc	2.971.854	1,68
383.208	Morgan Advanced Materials plc	997.874	0,56
121.125	Morgan Sindall plc	1.475.303	0,83
178.686	Oxford Instruments plc	2.283.607	1,29
577.163	Pearson plc	4.259.463	2,40
157.052	Pennon Group plc	1.298.820	0,73
864.916	Phoenix Group Holdings plc	5.979.164	3,37
782.116	Rank Group plc	1.482.892	0,84
238.110	RELX plc	4.601.476	2,60
1.749.710	Rentokil Initial plc	8.185.143	4,61
236.869	Royal Dutch Shell plc - B	5.675.381	3,20
1.214.314	RSA Insurance Group	6.486.866	3,66
238.910	Smiths Group plc	3.750.887	2,12
1.046.024	Stagecoach Group plc	1.398.534	0,79
503.518	Tate & Lyle plc	3.705.892	2,09

Cantidad	Inversión	Valor de mercado en GBP	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
REINO UNIDO (continuación)			
1.329.194	Tesco plc	3.203.358	1,81
130.213	Unilever plc	6.367.416	3,59
153.944	United Utilities Group plc	1.271.270	0,72
800.091	Wincanton plc	1.792.204	1,01
3.084.573	WM Morrison Supermarkets plc	6.178.399	3,49
	Total del Reino Unido	169.706.427	95,76
Total de renta variable		174.000.830	98,18
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		174.000.830	98,18
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Fondos			
IRLANDA			
2.000.535	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	2.000.535	1,13
	Total de Irlanda	2.000.535	1,13
Total de fondos		2.000.535	1,13
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		2.000.535	1,13
Valor total de las inversiones		176.001.365	99,31
(Coste total: GBP 174.274.022)			

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
EGIPTO				NIGERIA (continuación)			
488.200	Cleopatra Hospital	181.579	2,37	140.400	Seplat Petroleum Development	198.967	2,59
151.406	Commercial International Bank	721.926	9,40	161.547.689	Standard Alliance Insurance*	0	0,00
115.852	Credit Agricole	295.573	3,85	4.823.000	Zenith Bank plc	249.466	3,25
279.117	Eastern Company SAE	291.879	3,80		Total de Nigeria	1.284.583	16,73
283.225	Edita Food Industries	295.827	3,85				
188.130	ElSwedy Cables Holding Company	154.864	2,02				
242.386	Ibnsina Pharma SAE	148.714	1,94				
128.809	Juhayna Food Industries	69.289	0,90				
368.000	Obour Land for Food Industries	118.774	1,55				
	Total de Egipto	2.278.425	29,68				
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				REINO UNIDO			
39.588	Centamin plc	61.322	0,80	87.300	Vivo Energy plc	134.475	1,75
	Total de Jersey - Islas del Canal	61.322	0,80		Total del Reino Unido	134.475	1,75
KENIA				Total de renta variable			
1.202.000	Co-operative Bank of Kenya Limited	137.731	1,79			7.377.359	96,09
181.846	East African Breweries Limited	339.256	4,42	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
797.368	KCB Group Limited	322.470	4,20			7.377.359	96,09
2.830.045	Safaricom Limited	749.389	9,75	Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
	Total de Kenia	1.548.846	20,16	Renta variable			
MAURICIO				TANZANIA			
51.000	MCB Group Limited	416.515	5,43	1.340.500	CRDB Bank plc	58.312	0,76
	Total de Mauricio	416.515	5,43	14.050	Tanzania Breweries Limited	69.674	0,91
MARRUECOS					Total de Tanzania	127.986	1,67
7.470	Attijariwafa Bank	367.442	4,79	ZIMBABUE			
1.240	LafargeHolcim Maroc SA	216.247	2,82	193.596	Afrasia Zimbabwe Holdings Limited*	0	0,00
39.400	Maroc Telecom	573.937	7,48		Total de Zimbabue	0	0,00
930	Societe des Brasseries du Maroc	252.818	3,29	Total de renta variable			
13.150	Societe d'Exploitation des Ports	242.749	3,16			127.986	1,67
	Total de Marruecos	1.653.193	21,54	Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			
NIGERIA						127.986	1,67
358.000	Dangote Cement plc	150.020	1,95	Valor total de las inversiones			
3.900.000	Guaranty Trust Bank plc	314.992	4,10			7.505.345	97,76
322.723	MTN Nigeria Communications plc	116.491	1,52	(Coste total: USD 7.644.932)			
66.000	Nestle Nigeria plc	254.647	3,32	<i>*Valor razonable.</i>			

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable				Fondos			
PAÍSES BAJOS				IRLANDA			
16.704	NXP Semiconductor NV	1.822.740	0,99	15.238.706	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	15.238.706	8,25
	Total de los Países Bajos	1.822.740	0,99		Total de Irlanda	15.238.706	8,25
ESTADOS UNIDOS				Total de fondos			
12.430	Activision Blizzard Inc.	657.796	0,36	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
8.786	Adobe Inc.	2.427.132	1,31	Valor total de las inversiones			
15.518	Alexion Pharmaceuticals Inc.	1.519.833	0,82	(Coste total: USD 89.997.233)			
5.557	Alphabet Inc. - A	6.785.875	3,68				
2.026	Amazon.com Inc.	3.516.954	1,90				
8.725	Analog Devices Inc.	974.844	0,53				
5.997	Apple Inc.	1.343.148	0,73				
86.134	Bank of America Corp.	2.512.529	1,36				
39.901	Berkshire Hathaway Inc.	8.300.206	4,49				
3.117	Biogen Idec Inc.	725.700	0,39				
24.813	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	1.672.396	0,92				
1.969	Booking Holdings Inc.	3.864.379	2,09				
387.852	Centennial Resource Development - A	1.751.152	0,95				
4.849	Charter Communications Inc. - A	1.998.370	1,08				
8.722	Colgate-Palmolive Company	641.154	0,35				
3.985	Curtiss-Wright Corp.	515.539	0,28				
8.274	Edwards Lifesciences Corp.	1.819.535	0,99				
30.203	Facebook Inc. - A	5.378.551	2,91				
3.158	Illumina Inc.	960.727	0,52				
29.351	JPMorgan Chase & Company	3.454.319	1,87				
5.640	L3Harris Technologies Inc.	1.176.730	0,64				
24.114	Lam Research Corp.	5.572.987	3,01				
15.040	Mastercard Inc. - A	4.084.413	2,21				
9.148	Microsoft Corp.	1.271.846	0,69				
34.269	Moderna Inc.	545.562	0,30				
14.406	Norfolk Southern Corp.	2.588.182	1,40				
127.947	Nutanix Inc. - A	3.358.609	1,82				
15.738	Phillips 66	1.611.571	0,87				
156.566	Uber Technologies Inc.	4.770.566	2,58				
1.909	UnitedHealth Group Inc.	414.864	0,22				
9.845	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.667.940	0,90				
17.251	Visa Inc. - A	2.967.345	1,61				
6.243	VMware Inc. - A	936.825	0,51				
15.885	Walt Disney Company	2.070.133	1,12				
178.494	WPX Energy Inc.	1.890.251	1,02				
	Total de Estados Unidos	85.747.963	46,43				
	Total de renta variable	87.570.703	47,42				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	87.570.703	47,42				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
AUSTRALIA					FRANCIA				
USD	3.672.000	APT Pipelines Limited 4.20% 23/03/2025	3.577.155	0,21	EUR	1.706.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.734.432	0,10
GBP	3.392.000	APT Pipelines Limited 4.25% 26/11/2024	4.342.788	0,26	EUR	4.195.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	4.270.439	0,25
USD	5.869.000	BHP Billiton Finance Limited FRN 19/10/2075	6.308.691	0,37	EUR	8.000.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	8.876.240	0,52
EUR	6.350.000	BHP Billiton Finance Limited FRN 22/10/2079	7.769.330	0,46	GBP	9.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19/12/2024	10.518.795	0,62
EUR	4.300.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	4.504.596	0,27	USD	6.265.000	BNP Paribas SA Perp FRN	6.068.465	0,36
AUD	800.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 5.50% 12/03/2021	524.294	0,03	EUR	4.800.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	4.447.404	0,26
EUR	8.471.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 2.00% 30/06/2022	8.933.887	0,52	EUR	5.100.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	5.440.658	0,32
USD	8.152.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	7.736.564	0,46	USD	4.500.000	Credit Agricole SA Perp FRN	4.459.686	0,26
					EUR	9.900.000	Orange SA 0.00% 04/09/2026	9.767.322	0,58
					EUR	6.000.000	Sanofi 0.00% 13/01/2020	6.007.839	0,35
		Total de Australia	43.697.305	2,58			Total de Francia	61.591.280	3,62
BÉLGICA					ALEMANIA				
EUR	6.700.000	Belfius Bank SA Perp FRN	7.112.050	0,42	EUR	6.600.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	6.716.886	0,40
EUR	2.600.000	KBC Group NV Perp FRN	2.781.634	0,16					
		Total de Bélgica	9.893.684	0,58	EUR	2.900.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	3.077.313	0,18
CANADÁ					EUR	4.400.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	4.357.892	0,26
USD	7.500.000	Cenovus Energy Inc. 3.80% 15/09/2023	7.098.617	0,42	EUR	7.097.000	BASF SE FRN 15/11/2019	7.100.737	0,42
		Total de Canadá	7.098.617	0,42	EUR	3.798.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	3.939.854	0,23
ISLAS CAIMÁN					EUR	8.275.000	Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	8.539.096	0,50
USD	4.878.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	4.871.831	0,29	EUR	16.183.000	HeidelbergCement AG 8.50% 31/10/2019	16.294.370	0,96
USD	4.489.000	Noble Holding International Limited 8.95% 01/04/2045	2.105.119	0,12	EUR	3.159.000	Innogy Finance BV 5.75% 14/02/2033	5.151.793	0,30
USD	1.172.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	1.153.937	0,07	EUR	5.630.000	Safari Verwaltungs GmbH 5.38% 30/11/2022	3.641.822	0,21
GBP	5.506.000	Thames Water Utilities Cayman 2.88% 03/05/2027	6.333.316	0,37	EUR	4.979.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	4.726.067	0,28
		Total de las Islas Caimán	14.464.203	0,85	EUR	5.073.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	5.502.817	0,32
FINLANDIA					EUR	1.940.000	Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	1.988.750	0,12
EUR	1.768.000	Sampo Oyj FRN 23/05/2049	1.999.396	0,12	EUR	5.000.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	4.906.516	0,29
		Total de Finlandia	1.999.396	0,12			Total de Alemania	75.943.913	4,47

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
INDIA					LUXEMBURGO				
USD	8.251.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	7.041.429	0,42	USD	6.625.000	Altice Finco SA 8.13% 15/01/2024	6.286.302	0,37
	Total de India		7.041.429	0,42	EUR	197.000	Altice Finco SA 9.00% 15/06/2023	204.983	0,01
IRLANDA					EUR	9.375.000	Altice Luxembourg SA 8.00% 15/05/2027	10.323.023	0,61
EUR	10.700.000	Abbott Ireland Financing DAC 0.00% 27/09/2020	10.712.631	0,63	EUR	14.880.000	Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	15.565.953	0,92
EUR	8.380.000	AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	9.007.880	0,53	EUR	8.245.000	Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	8.530.882	0,50
EUR	2.707.000	Allied Irish Banks FRN 29/12/2049	2.882.206	0,17	EUR	2.750.000	DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	2.759.920	0,16
EUR	2.941.000	Bank of Ireland Perp FRN	3.059.715	0,18	EUR	3.928.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 6.75% 14/10/2019	3.936.465	0,23
EUR	7.369.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	7.881.027	0,47	EUR	15.300.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	15.954.852	0,94
EUR	2.352.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	2.527.192	0,15	EUR	4.300.000	Grand City Properties SA Perp FRN	4.598.384	0,27
USD	10.665.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	10.291.434	0,61	EUR	3.359.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	3.248.663	0,19
GBP	4.150.000	GE Capital UK Funding Unlimited Company 5.88% 04/11/2020	4.907.805	0,29	EUR	10.174.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	10.425.637	0,62
EUR	3.500.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	3.937.583	0,23	EUR	914.000	Leonardo SpA 4.50% 19/01/2021	965.564	0,06
	Total de Irlanda		55.207.473	3,26	GBP	7.163.000	Leonardo SpA 8.00% 16/12/2019	8.204.878	0,48
ITALIA					EUR	4.034.000	LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 15/03/2024	4.154.363	0,25
EUR	3.870.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	3.939.713	0,23	EUR	1.530.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	1.564.152	0,09
EUR	11.599.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	11.904.006	0,71	EUR	1.855.000	Medtronic Global Holdings SCA FRN 07/03/2021	1.862.275	0,11
EUR	3.804.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	3.808.299	0,22	EUR	1.069.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 02/07/2031	1.114.236	0,07
EUR	6.869.000	Nexi Capital SpA 4.13% 01/11/2023	7.074.864	0,42	EUR	15.479.000	Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	16.070.871	0,94
	Total de Italia		26.726.882	1,58		Total de Luxemburgo		115.771.403	6,82
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					PAÍSES BAJOS				
GBP	3.840.000	Cpuk Finance Limited 4.25% 28/08/2022	4.436.350	0,26	EUR	4.579.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	4.688.479	0,28
GBP	1.470.000	Cpuk Finance Limited 4.88% 28/08/2025	1.716.955	0,10	EUR	5.000.000	Deutsche Telekom International Finance BV FRN 03/04/2020	5.008.032	0,30
EUR	7.125.000	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	7.435.214	0,44	EUR	10.000.000	Deutsche Telekom International Finance BV 0.38% 30/10/2021	10.107.942	0,60
	Total de Jersey - Islas del Canal		13.588.519	0,80	EUR	3.678.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	3.816.799	0,23
					GBP	7.450.000	Intergen NV 7.50% 30/06/2021	8.354.168	0,49
					GBP	3.615.000	Koninklijke KPN NV FRN 14/03/2073	4.180.843	0,25

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
PAÍSES BAJOS (continuación)					SUIZA				
EUR	7.700.000	Nederlandse Gasunie NV 0.00% 18/11/2019	7.702.286	0,46	USD	6.600.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	6.658.598	0,39
EUR	9.000.000	Selecta Group BV 5.88% 01/02/2024	9.373.541	0,55	USD	9.000.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	8.351.297	0,49
EUR	2.985.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.00% 05/09/2021	3.000.730	0,18	USD	3.906.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	3.816.608	0,23
EUR	8.609.000	Stedin Holding NV Perp FRN	9.110.546	0,54	Total de Suiza			18.826.503	1,11
USD	19.696.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	19.113.233	1,13	REINO UNIDO				
EUR	8.400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	8.573.145	0,51	GBP	4.453.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	4.848.155	0,29
GBP	1.400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.674.917	0,10	GBP	6.945.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	9.516.197	0,56
EUR	10.541.000	TenneT Holding BV Perp FRN	11.284.811	0,66	EUR	200.000	Barclays Bank plc 6.63% 30/03/2022	229.083	0,01
EUR	1.516.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 0.38% 25/07/2020	1.479.195	0,09	GBP	4.400.000	Barclays Bank plc Perp FRN	5.278.758	0,31
USD	5.000.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.20% 21/07/2021	4.205.077	0,25	GBP	9.752.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	12.503.068	0,74
GBP	2.400.000	Volkswagen Financial Services NV 2.75% 10/07/2023	2.814.736	0,17	EUR	3.572.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	3.647.601	0,22
EUR	3.200.000	Vonovia Finance BV 0.13% 06/04/2023	3.207.736	0,19	GBP	8.750.000	Cadent Finance plc 2.13% 22/09/2028	10.157.234	0,60
Total de los Países Bajos			117.696.216	6,98	GBP	15.547.000	Co-operative Group 6.88% 08/07/2020	18.304.937	1,08
NORUEGA					GBP	2.450.000	Cybg plc FRN 09/02/2026	2.748.163	0,16
EUR	5.299.000	DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	5.356.129	0,32	EUR	12.106.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	11.961.372	0,70
Total de Noruega			5.356.129	0,32	EUR	5.998.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	6.195.508	0,37
ESPAÑA					USD	16.724.044	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	12.674.961	0,75
EUR	3.200.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	3.434.838	0,20	GBP	8.970.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	11.494.319	0,68
EUR	9.700.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	10.110.106	0,60	EUR	10.015.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	10.326.876	0,61
EUR	8.975.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	9.748.118	0,58	EUR	8.485.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	8.864.404	0,52
Total de España			23.293.062	1,38	GBP	9.441.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	10.880.640	0,64
SUECIA					GBP	3.919.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	4.813.350	0,28
EUR	6.145.000	Akelius Residential Property AB FRN 05/10/2078	6.604.345	0,39	GBP	7.733.000	GKN Holdings plc 6.75% 28/10/2019	8.772.627	0,52
EUR	6.327.000	Akelius Residential Property AB 1.50% 23/01/2022	6.537.541	0,39	GBP	224.437	Greene King Finance plc FRN 15/09/2021	253.189	0,01
EUR	15.400.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	16.239.493	0,96	EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	7.423.920	0,44
EUR	3.582.000	Akelius Residential Property AB 3.38% 23/09/2020	3.703.297	0,22	GBP	2.920.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	4.296.938	0,25
Total de Suecia			33.084.676	1,96	GBP	5.550.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	6.643.033	0,39
					EUR	5.930.000	Imperial Brands Finance plc 1.13% 14/08/2023	6.062.175	0,36

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
REINO UNIDO (continuación)					REINO UNIDO (continuación)				
GBP	1.834.233	Intu Debenture plc 5.56% 31/12/2027	1.679.652	0,10	GBP	819.390	Telereal Securitisation plc 5.55% 10/12/2031	1.146.053	0,07
GBP	4.655.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	4.968.909	0,29	GBP	6.778.609	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	9.992.800	0,59
GBP	4.630.000	Legal & General Group plc FRN 23/07/2041	6.015.715	0,36	GBP	8.021.217	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	11.721.593	0,69
GBP	5.320.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc 1.75% 11/07/2024	6.050.993	0,36	GBP	9.550.000	Thames Water Utilities Finance plc 5.05% 30/06/2020	11.074.752	0,65
GBP	12.060.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	17.506.269	1,04	GBP	7.120.000	Tsb Banking Group plc FRN 06/05/2026	8.167.336	0,48
GBP	1.279.000	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	1.321.619	0,08	USD	8.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	8.432.448	0,50
GBP	79.590	Marston's Issuer plc FRN 15/07/2020	89.627	0,01	GBP	9.010.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	10.924.392	0,64
GBP	1.967.182	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	2.571.673	0,15	Total del Reino Unido			380.457.431	22,46
GBP	263.030	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	318.892	0,02	ESTADOS UNIDOS				
EUR	5.941.000	National Express Group plc FRN 15/05/2020	5.937.510	0,35	USD	10.000.000	American Electric Power Company Inc. 3.20% 13/11/2027	9.589.487	0,57
GBP	1.507.000	Nationwide Building Society Perp FRN	1.743.780	0,10	GBP	5.500.000	American International Group Inc. 5.00% 26/04/2023	7.018.678	0,41
EUR	4.906.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	4.881.012	0,29	USD	14.650.000	Anheuser-Busch Companies LLC 3.65% 01/02/2026	14.419.041	0,85
EUR	1.770.000	OTE plc 3.50% 09/07/2020	1.816.122	0,11	USD	5.380.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	6.259.799	0,37
EUR	3.276.000	OTE plc 4.38% 02/12/2019	3.299.751	0,19	EUR	10.280.000	AT&T Inc. FRN 05/09/2023	10.427.797	0,61
GBP	14.160.000	Pennon Group plc Perp FRN	16.122.645	0,95	USD	2.820.000	AT&T Inc. 3.80% 15/02/2027	2.742.476	0,16
GBP	2.155.000	Prudential plc FRN 20/07/2049	2.499.155	0,15	EUR	9.081.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	9.725.186	0,57
EUR	2.341.000	Royal Bank of Scotland FRN 02/03/2026	2.447.521	0,14	USD	22.350.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	20.745.144	1,22
GBP	10.475.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 19/09/2026	12.225.493	0,73	USD	11.328.000	Bayer USA Finance II LLC 4.25% 15/12/2025	11.101.669	0,66
USD	7.700.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 08/05/2030	7.574.608	0,45	EUR	15.265.000	Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	15.866.063	0,94
USD	4.600.000	Santander UK plc 2.88% 18/06/2024	4.288.765	0,25	USD	7.400.000	Becton Dickinson and Company 2.40% 05/06/2020	6.793.786	0,40
GBP	3.100.000	Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	5.663.442	0,33	USD	16.245.000	Becton Dickinson and Company FRN 06/06/2022	14.967.927	0,88
GBP	8.612.000	Severn Trent Water 3.63% 16/01/2026	10.970.145	0,65	USD	6.629.000	Becton Dickinson and Company 3.70% 06/06/2027	6.453.446	0,38
GBP	604.000	Stonegate Pub Company Financing plc FRN 15/03/2022	690.952	0,04	GBP	2.394.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 2.63% 19/06/2059	3.173.893	0,19
EUR	5.370.000	Synlab Bondco plc FRN 01/07/2022	5.398.081	0,32	EUR	7.244.000	Berkshire Hathaway Inc. 0.25% 17/01/2021	7.285.600	0,42
GBP	6.104.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	7.165.508	0,42	EUR	7.000.000	Berkshire Hathaway Inc. 0.50% 13/03/2020	7.021.005	0,41
GBP	4.010.108	Telereal Securitisation plc 4.97% 10/09/2027	5.214.426	0,31	USD	12.782.000	Broadcom Cayman Finance 3.63% 15/01/2024	11.987.341	0,71
GBP	1.891.095	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	2.639.284	0,16					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

		Valor de mercado	% del valor			Valor de mercado	% del valor		
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo		
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos (continuación)				Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)				ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					
USD	3.949.000	Continental Resources Inc. 5.00% 15/09/2022	3.656.447	0,22	GBP	5.330.000	Global Switch Holdings Limited 4.38% 13/12/2022	6.582.216	0,39
EUR	5.333.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	5.886.730	0,34	Total de las Islas Vírgenes (Británicas)			6.582.216	0,39
GBP	10.701.000	Digital Stout Holding LLC 3.30% 19/07/2029	13.151.858	0,78	Total de bonos			1.359.540.439	80,24
USD	6.000.000	Duke Energy Corp 3.40% 15/06/2029	5.788.775	0,34	Valores respaldados por hipotecas y activos				
EUR	8.930.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	9.275.177	0,55	REINO UNIDO				
EUR	5.135.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	5.360.752	0,32	GBP	7.841.436	Towd Point Mortgage Funding 2016 - Auburn 10 plc FRN 20/04/2045	8.866.213	0,52
EUR	4.401.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	4.716.996	0,28	Total del Reino Unido			8.866.213	0,52
EUR	6.233.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	6.940.533	0,41	Total de valores respaldados por hipotecas y activos			8.866.213	0,52
EUR	1.969.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	2.431.017	0,14	Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda				
EUR	854.000	Fiserv Inc. 0.38% 01/07/2023	862.615	0,05	MÉXICO				
EUR	1.408.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	1.466.636	0,09	GBP	1.955.000	Mexico (Govt of) Perp 5.63%	2.447.376	0,14
EUR	2.633.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	2.837.125	0,17	Total de México			2.447.376	0,14
USD	4.725.000	Ford Motor Credit CompanyLLC 5.58% 18/03/2024	4.614.518	0,27	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			2.447.376	0,14
EUR	3.591.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	3.706.060	0,22	Bonos - convertibles				
EUR	9.318.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	9.513.388	0,56	FRANCIA				
USD	17.750.000	Kinder Morgan Inc. 3.15% 15/01/2023	16.668.835	0,98	GBP	6.600.000	Orange SA 0.38% 27/06/2021	7.332.662	0,43
EUR	4.060.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	4.329.486	0,26	Total de Francia			7.332.662	0,43
GBP	4.850.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	6.002.229	0,35	JERSEY - ISLAS DEL CANAL				
EUR	7.360.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	7.645.434	0,45	GBP	4.500.000	British Land White 2015 Limited 0.00% 09/06/2020	5.030.931	0,30
EUR	7.450.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	7.920.244	0,47	Total de Jersey - Islas del Canal			5.030.931	0,30
USD	5.000.000	NiSource Inc. 3.49% 15/05/2027	4.816.089	0,28	MÉXICO				
USD	12.410.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	12.187.087	0,72	EUR	4.700.000	America Movil SAB de CV 0.00% 28/05/2020	4.692.428	0,28
USD	13.330.000	Qualcomm Inc. FRN 30/01/2023	12.284.398	0,73	Total de México			4.692.428	0,28
USD	5.000.000	Teva Pharmaceutical Finance BV 3.65% 10/11/2021	4.259.769	0,25	Total de bonos - convertibles			17.056.021	1,01
USD	4.310.000	Teva Pharmaceutical Finance IV LLC 2.25% 18/03/2020	3.905.598	0,23	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			1.387.910.049	81,91
EUR	3.362.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	3.380.054	0,20					
USD	6.410.000	Voya Financial Inc. 3.13% 15/07/2024	6.071.805	0,36					
GBP	4.336.000	Welltower Inc. 4.80% 20/11/2028	5.962.109	0,35					
Total de Estados Unidos		341.220.102	20,12						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Valor nominal		Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario (continuación)				
Bonos					Bonos (continuación)				
AUSTRALIA					PORTUGAL				
USD	9.912.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	9.759.078	0,58	EUR	17.100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	3.570.053	0,21
Total de Australia			9.759.078	0,58	Total de Portugal			3.570.053	0,21
BERMUDAS					REINO UNIDO				
USD	20.765.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	20.361.370	1,20	GBP	5.119.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	5.911.597	0,36
USD	27.250.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	27.283.059	1,61	Total del Reino Unido			5.911.597	0,36
Total de Bermudas			47.644.429	2,81	Total de bonos			13.613.610	0,81
					Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			13.613.610	0,81
DINAMARCA					Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
USD	4.907.000	Danske Bank A/S 2.70% 02/03/2022	4.525.147	0,27	Fondos				
Total de Dinamarca			4.525.147	0,27	IRLANDA				
FRANCIA					13.626.288	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	15.402.379	0,91	
USD	6.500.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	5.934.762	0,35	12.676.983	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	11.628.126	0,69	
USD	6.470.000	Electricite de France SA 4.88% 21/09/2038	6.954.808	0,41	851.147	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	84.898.205	5,01	
Total de Francia			12.889.570	0,76	Total de Irlanda			111.928.710	6,61
PAÍSES BAJOS					Total de fondos			111.928.710	6,61
USD	3.625.000	NXP BV 3.88% 01/09/2022	3.433.922	0,20	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			111.928.710	6,61
USD	4.036.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	3.991.188	0,24	Valor total de las inversiones			1.595.695.703	94,19
Total de los Países Bajos			7.425.110	0,44	(Coste total: EUR 1.529.092.917)				
Total de bonos			82.243.334	4,86					
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente									
82.243.334					4,86				
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario									
Bonos									
CANADÁ									
CAD	5.933.000	Canadian Natural Resources Limited 2.89% 14/08/2020	4.131.960	0,24					
Total de Canadá			4.131.960	0,24					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

		Valor de mercado		%		Valor de mercado		%	
Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión	EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					
Bonos				Bonos (continuación)					
AUSTRALIA				FRANCIA (continuación)					
EUR	373.000	APT Pipelines Limited 2.00% 22/03/2027	408.359	0,46	EUR	700.000	Electricite de France SA 2.00% 02/10/2030	795.692	0,91
USD	561.000	APT Pipelines Limited 4.20% 23/03/2025	546.510	0,62	EUR	400.000	HSBC France SA 0.10% 03/09/2027	396.106	0,45
GBP	246.000	APT Pipelines Limited 4.25% 26/11/2024	314.955	0,36	EUR	1.000.000	Orange SA 0.00% 04/09/2026	986.599	1,12
USD	200.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	196.914	0,22	EUR	200.000	RCI Banque SA 2.00% 11/07/2024	213.974	0,24
USD	1.000.000	AusNet Services Holdings Pty Limited FRN 17/03/2076	965.993	1,10	EUR	1.000.000	Sanofi 0.00% 21/03/2022	1.004.941	1,14
USD	400.000	Bhp Billiton Finance FRN 19/10/2075	429.967	0,49	Total de Francia			6.395.152	7,27
EUR	400.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	419.032	0,48	ALEMANIA				
USD	20.000	Pacific National Finance Pty Limited 4.63% 23/09/2020	18.677	0,02	EUR	500.000	Adler Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	504.864	0,58
Total de Australia		3.300.407	3,75	EUR	100.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	106.114	0,12	
BÉLGICA				EUR	400.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	396.172	0,45	
GBP	175.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.25% 24/05/2029	206.502	0,24	EUR	673.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	698.136	0,79
EUR	400.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	394.996	0,45	EUR	525.000	Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	541.755	0,62
EUR	200.000	KBC Group NV Perp FRN	213.972	0,24	EUR	200.000	Eurogrid GmbH 1.50% 18/04/2028	218.914	0,25
Total de Bélgica		815.470	0,93	EUR	500.000	Eurogrid GmbH 1.88% 10/06/2025	548.413	0,62	
BERMUDAS				EUR	500.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	490.652	0,56	
EUR	810.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	877.556	1,00	EUR	100.000	Volkswagen Bank GmbH 2.50% 31/07/2026	109.908	0,13
Total de Bermudas		877.556	1,00	Total de Alemania			3.614.928	4,12	
FINLANDIA				IRLANDA					
EUR	139.000	Sampo Oyj FRN 23/05/2049	157.192	0,18	EUR	650.000	Abbott Ireland Financing DAC 0.00% 27/09/2020	650.767	0,74
Total de Finlandia		157.192	0,18	EUR	250.000	AIB Group plc 1.25% 28/05/2024	255.442	0,29	
FRANCIA				EUR	440.000	AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	472.967	0,54	
EUR	500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	517.874	0,59	EUR	500.000	Bank of Ireland Group plc FRN 08/07/2024	500.103	0,57
GBP	500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19/12/2024	577.956	0,66	EUR	188.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	202.003	0,23
USD	235.000	BNP Paribas SA Perp FRN	227.628	0,26	USD	600.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	578.985	0,66
EUR	700.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	746.757	0,85	GBP	150.000	GE Capital UK Funding Unlimited Company 4.13% 13/09/2023	182.686	0,21
USD	400.000	Credit Agricole SA Perp FRN	396.417	0,45	GBP	50.000	GE Capital UK Funding Unlimited Company 5.88% 04/11/2020	59.130	0,07
EUR	500.000	Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	531.208	0,60					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
IRLANDA (continuación)					MÉXICO				
GBP	100.000	Phoenix Group Holdings plc 4.13% 20/07/2022	118.111	0,13	GBP	310.000	America Movil SAB de CV FRN 06/09/2073	365.191	0,42
EUR	391.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	439.884	0,50	EUR	125.000	America Movil SAB de CV FRN 06/09/2073	151.015	0,17
		Total de Irlanda	3.460.078	3,94	USD	240.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	229.436	0,26
							Total de México	745.642	0,85
ITALIA					PAÍSES BAJOS				
EUR	100.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	101.801	0,12	EUR	500.000	ABB Finance BV FRN 12/10/2020	501.561	0,57
EUR	202.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	207.312	0,24	EUR	325.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	332.770	0,38
EUR	250.000	FCA Bank SpA FRN 17/06/2021	249.896	0,28	GBP	72.000	Deutsche Telekom International Finance BV 2.50% 10/10/2025	86.498	0,10
EUR	380.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	380.429	0,43	EUR	509.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	528.209	0,60
EUR	237.000	FCA Bank SpA 0.63% 24/11/2022	239.584	0,27	GBP	330.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	520.246	0,59
		Total de Italia	1.179.022	1,34	GBP	200.000	Innogy Finance BV 6.50% 20/04/2021	244.179	0,28
JAPÓN					EUR	300.000	Nederlandse Gasunie NV 0.00% 18/11/2019	300.089	0,34
EUR	308.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.55% 06/11/2023	318.158	0,36	EUR	1.070.000	RELX Finance BV 0.38% 22/03/2021	1.077.656	1,23
		Total de Japón	318.158	0,36	EUR	765.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.00% 05/09/2021	769.031	0,88
LUXEMBURGO					USD	1.083.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	1.050.957	1,20
EUR	300.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.17% 04/06/2021	301.198	0,34	USD	200.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	194.082	0,22
EUR	471.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	486.715	0,55	EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	110.264	0,13
EUR	500.000	Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	523.049	0,60	EUR	355.000	TenneT Holding BV 2.13% 01/11/2020	363.772	0,41
USD	200.000	CPI Property Group SA 4.75% 08/03/2023	193.045	0,22	GBP	400.000	Volkswagen Financial Services NV 2.75% 10/07/2023	469.123	0,53
EUR	291.000	DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	292.050	0,33	EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 1.13% 02/10/2023	102.813	0,12
EUR	224.000	DH Europe Finance II Sarl 0.75% 18/09/2031	225.259	0,26	EUR	300.000	Vonovia Finance BV 0.13% 06/04/2023	300.725	0,34
EUR	500.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	521.400	0,59			Total de los Países Bajos	6.951.975	7,92
EUR	700.000	Medtronic Global Holdings SCA 0.00% 07/03/2021	701.607	0,79	NORUEGA				
EUR	145.000	Medtronic Global Holdings SCA FRN 07/03/2021	145.569	0,17	EUR	1.039.000	DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	1.050.201	1,19
EUR	101.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 02/07/2031	105.274	0,12			Total de Noruega	1.050.201	1,19
EUR	1.300.000	Novartis Finance SA 0.00% 31/03/2021	1.307.267	1,49					
		Total de Luxemburgo	4.802.433	5,46					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
ESPAÑA					REINO UNIDO (continuación)				
EUR	100.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 18/01/2029	107.925	0,12	GBP	60.000	Eastern Power Networks plc 5.75% 08/03/2024	80.860	0,09
EUR	100.000	Bankia SA 0.88% 25/03/2024	102.886	0,12	EUR	650.000	Experian Finance plc 4.75% 04/02/2020	661.130	0,75
EUR	300.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	322.016	0,37					
EUR	100.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	104.228	0,12	GBP	370.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	474.125	0,54
EUR	600.000	CaixaBank SA 1.13% 27/03/2026	629.029	0,72					
EUR	784.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	851.535	0,97	EUR	100.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	104.471	0,12
	Total de España		2.117.619	2,42	GBP	200.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	230.498	0,26
SUECIA					GBP	300.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	368.462	0,42
EUR	1.000.000	Akelius Residential 1.13% 14/03/2024	1.029.051	1,17	EUR	152.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	173.606	0,20
EUR	400.000	Essity AB 0.50% 26/05/2021	404.234	0,46	EUR	648.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	740.108	0,84
EUR	400.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	419.597	0,48	GBP	500.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	735.777	0,84
	Total de Suecia		1.852.882	2,11	GBP	400.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	478.777	0,55
SUIZA					USD	380.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	348.718	0,40
USD	400.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	406.786	0,46	GBP	400.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	547.136	0,62
EUR	615.000	UBS AG 0.63% 23/01/2023	629.626	0,72	GBP	200.000	Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	251.565	0,29
USD	200.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	195.423	0,22	GBP	50.000	Legal & General Group plc FRN 23/07/2041	64.965	0,07
	Total de Suiza		1.231.835	1,40	GBP	794.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc 1.75% 11/07/2024	903.099	1,03
REINO UNIDO					GBP	125.000	Marks & Spencer plc 6.13% 06/12/2021	154.673	0,18
EUR	250.000	Anglo American Capital plc 2.88% 20/11/2020	258.377	0,29	GBP	60.000	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	61.999	0,07
GBP	125.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	171.278	0,19	EUR	647.000	Motability Operations Group plc 0.38% 03/01/2026	649.588	0,74
EUR	500.000	Barclays Bank plc 6.63% 30/03/2022	572.706	0,65	GBP	200.000	Nationwide Building Society Perp FRN	231.424	0,26
GBP	400.000	Barclays plc Perp FRN	479.887	0,55	EUR	570.000	NatWest Markets plc 1.00% 28/05/2024	582.406	0,66
EUR	400.000	British Telecommunications plc 0.63% 10/03/2021	404.207	0,46	USD	250.000	NatWest Markets plc 3.63% 29/09/2022	235.383	0,27
EUR	300.000	British Telecommunications plc 1.50% 23/06/2027	314.834	0,36	EUR	513.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	510.387	0,58
GBP	46.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	64.525	0,07	GBP	100.000	NIE Finance plc 2.50% 27/10/2025	119.510	0,14
GBP	300.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	384.631	0,44	GBP	395.000	Northumbrian Water Finance plc 1.63% 11/10/2026	449.643	0,51
EUR	960.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	980.319	1,12	GBP	500.000	Pennon Group plc Perp FRN	569.302	0,65
EUR	540.000	Diageo Finance plc 0.00% 17/11/2020	541.422	0,62	GBP	211.000	Prudential plc FRN 20/07/2049	244.697	0,28
EUR	1.171.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	1.157.010	1,32	GBP	287.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 28/03/2027	337.794	0,38
EUR	256.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	264.430	0,30					

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo				Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valor nominal	Inversión				Valor nominal	Inversión			
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)				
REINO UNIDO (continuación)					ESTADOS UNIDOS (continuación)				
USD	280.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 08/05/2030	275.440	0,31	USD	325.000	BP Capital Markets America Inc. 4.23% 06/11/2028	337.787	0,38
USD	400.000	Santander UK plc 2.88% 18/06/2024	372.936	0,42	USD	165.000	Broadcom Cayman Finance 3.63% 15/01/2024	154.742	0,18
GBP	100.000	Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	182.692	0,21	USD	210.000	Cardinal Health Inc. 4.37% 15/06/2047	185.403	0,21
GBP	200.000	Scottish Hydro Electric Transmission plc 2.25% 27/09/2035	227.686	0,26	USD	600.000	Charter Communications Operating LLC 3.58% 23/07/2020	555.350	0,63
GBP	75.000	Severn Trent Utilities Finance plc 6.13% 26/02/2024	102.098	0,12	EUR	400.000	Coca-Cola Company FRN 08/03/2021	401.716	0,46
GBP	78.975	Telereal Securitisation plc 4.97% 10/09/2027	102.693	0,12	EUR	400.000	Coca-Cola Company 0.13% 22/09/2022	403.408	0,46
GBP	158.725	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	221.523	0,25	EUR	540.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	596.069	0,68
GBP	429.549	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	712.489	0,81	EUR	200.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	220.766	0,25
GBP	328.918	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	484.880	0,55	GBP	200.000	Digital Stout Holding LLC 3.75% 17/10/2030	254.726	0,29
GBP	122.000	TSB Bank plc FRN 15/02/2024	139.393	0,16	USD	185.000	Duke Energy Corp 2.65% 01/09/2026	170.630	0,19
GBP	700.000	TSB Banking Group plc FRN 06/05/2026	802.968	0,91	USD	540.000	Duke Energy Corp 3.40% 15/06/2029	520.990	0,59
GBP	75.000	Unite Group plc 6.13% 12/06/2020	87.063	0,10	EUR	500.000	Fidelity National Information Services Inc. FRN 21/05/2021	500.824	0,57
GBP	500.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	606.237	0,69	EUR	351.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	376.202	0,43
		Total del Reino Unido	20.221.827	23,02	EUR	100.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	111.351	0,13
ESTADOS UNIDOS					EUR	486.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	541.169	0,61
USD	200.000	Anheuser-Busch Companies LLC 3.65% 01/02/2026	196.847	0,22	EUR	214.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	264.214	0,30
USD	140.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	162.894	0,19	EUR	100.000	Fiserv Inc. 0.38% 01/07/2023	101.009	0,11
EUR	500.000	AT&T Inc. 1.95% 15/09/2023	533.587	0,61	EUR	112.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	116.664	0,13
USD	600.000	AT&T Inc. 3.80% 15/02/2027	583.506	0,66	EUR	208.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	224.125	0,26
USD	1.100.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	1.021.014	1,16	USD	275.000	Ford Motor Credit CompanyLLC 5.58% 18/03/2024	268.570	0,31
USD	400.000	Bayer USA Finance II LLC 4.25% 15/12/2025	392.008	0,45	GBP	200.000	Goldman Sachs Group Inc. 3.13% 25/07/2029	246.468	0,28
EUR	517.000	Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	537.357	0,61	USD	410.000	Kinder Morgan Inc. 4.30% 01/06/2025	406.938	0,46
GBP	500.000	Becton Dickinson and Company 3.02% 24/05/2025	603.452	0,70	EUR	300.000	Kraft Heinz Foods Company 2.00% 30/06/2023	314.422	0,36
USD	75.000	Becton Dickinson and Company FRN 06/06/2022	69.104	0,08	EUR	384.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	409.488	0,47
GBP	139.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 2.63% 19/06/2059	184.282	0,21	GBP	461.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	570.522	0,64
					EUR	394.000	Metropolitan Life Global Funding I 0.38% 09/04/2024	399.839	0,46

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

			Valor de mercado	% del valor				Valor de mercado	% del valor	
Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	Valor nominal	Inversión		EUR	liquidativo	
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)					Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
Bonos (continuación)					Bonos (continuación)					
ESTADOS UNIDOS (continuación)					AUSTRALIA					
USD	600.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2.90% 01/04/2022	560.572	0,64	USD	500.000	Ausgrid Finance Pty Limited 3.85% 01/05/2023	477.714	0,54	
USD	1.110.000	NiSource Inc. 3.49% 15/05/2027	1.069.172	1,22	USD	445.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	444.112	0,51	
EUR	100.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 24/02/2025	112.110	0,13	Total de Australia			921.826	1,05	
USD	1.260.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	1.237.367	1,42	BERMUDAS					
EUR	346.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	347.858	0,40	USD	900.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	882.507	0,99	
EUR	1.000.000	Toyota Motor Credit Corp. 1.00% 10/09/2021	1.022.615	1,16	USD	690.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	690.837	0,79	
USD	280.000	Williams Cos Inc. 4.30% 04/03/2024	273.108	0,31	Total de Bermudas			1.573.344	1,78	
Total de Estados Unidos			17.560.245	20,01	DINAMARCA					
ISLAS VÍRGENES (BRITÁNICAS)					USD	400.000	Danske Bank A/S 2.70% 02/03/2022	368.873	0,42	
EUR	670.000	Global Switch Holdings Limited 1.50% 31/01/2024	698.210	0,79	Total de Dinamarca			368.873	0,42	
USD	240.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	232.930	0,27	FRANCIA					
Total de las Islas Vírgenes (Británicas)			931.140	1,06	USD	200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 20/07/2023	185.006	0,21	
Total de bonos			77.583.762	88,33	USD	1.000.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	913.040	1,03	
Bonos - convertibles					Total de Francia			1.098.046	1,24	
FRANCIA					PAÍSES BAJOS					
GBP	100.000	Orange SA 0.38% 27/06/2021	111.101	0,13	USD	375.000	NXP BV 3.88% 01/09/2022	355.233	0,40	
Total de Francia			111.101	0,13	USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	49.445	0,06	
JERSEY - ISLAS DEL CANAL					Total de los Países Bajos			404.678	0,46	
GBP	400.000	British Land White 2015 Limited 0.00% 09/06/2020	447.193	0,51	ESTADOS UNIDOS					
Total de Jersey - Islas del Canal			447.193	0,51	USD	773.000	Broadcom Inc. 3.13% 15/04/2021	715.953	0,82	
MÉXICO					Total de Estados Unidos			715.953	0,82	
EUR	300.000	America Movil SAB de CV 0.00% 28/05/2020	299.517	0,34	Total de bonos			5.082.720	5,77	
Total de México			299.517	0,34	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente					
Total de bonos - convertibles			857.811	0,98	5.082.720					5,77
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			78.441.573	89,31						

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

	Valor nominal	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario				
Bonos				
SUECIA				
USD	200.000	Nordea Bank Abp FRN 30/08/2023	182.384	0,21
		Total de Suecia	182.384	0,21
ESTADOS UNIDOS				
USD	200.000	Metropolitan Life Global Funding I FRN 07/09/2020	183.968	0,21
CAD	800.000	Molson Coors International LP 2.75% 18/09/2020	555.857	0,63
		Total de Estados Unidos	739.825	0,84
Total de bonos			922.209	1,05
Total de otros valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario			922.209	1,05
Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios				
Fondos				
IRLANDA				
	963	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	96.094	0,11
		Total de Irlanda	96.094	0,11
Total de fondos			96.094	0,11
Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			96.094	0,11
Valor total de las inversiones			84.542.596	96,24
(Coste total: EUR 81.709.104)				

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado EUR	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BERMUDAS				SUIZA			
82.744	IHS Markit Limited	5.076.058	4,91	12.097	Lonza Group AG - Reg	3.754.534	3,63
	Total de Bermudas	5.076.058	4,91	50.777	Nestle SA - Reg	5.057.647	4,89
DINAMARCA				6.569	Partners Group Holding AG - Reg	4.627.516	4,48
27.932	DSV A/S	2.438.432	2,36		Total de Suiza	13.439.697	13,00
100.194	Novo-Nordisk A/S	4.725.673	4,56	REINO UNIDO			
	Total de Dinamarca	7.164.105	6,92	320.561	3i Group plc	4.226.741	4,08
FRANCIA				271.358	Informa plc	2.613.319	2,52
27.930	Air Liquide SA	3.647.658	3,52	23.397	Linde plc	4.164.666	4,02
58.076	Amundi SA	3.716.864	3,59	101.298	Smith & Nephew plc	2.243.084	2,17
94.129	Edenred	4.144.500	4,00		Total del Reino Unido	13.247.810	12,79
7.833	EssilorLuxottica SA	1.035.914	1,00	Total de renta variable			
2.724	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	993.307	0,96		Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	101.759.445	98,30
6.281	Pernod-Ricard SA	1.026.315	0,99	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
42.461	Sanofi	3.611.733	3,49	Fondos			
32.465	Schneider Electric SE	2.613.433	2,52	IRLANDA			
24.352	Teleperformance	4.843.613	4,68	25.155	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	2.509.145	2,42
	Total de Francia	25.633.337	24,75		Total de Irlanda	2.509.145	2,42
ALEMANIA				Total de fondos			
3.639	Adidas AG	1.039.480	1,00		Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios	2.509.145	2,42
34.456	Deutsche Boerse AG	4.940.990	4,78		Valor total de las inversiones	104.268.590	100,72
	Total de Alemania	5.980.470	5,78	(Coste total: EUR 98.525.776)			
IRLANDA							
132.387	CRH plc	4.172.039	4,03				
33.285	Medtronic Inc.	3.316.288	3,20				
	Total de Irlanda	7.488.327	7,23				
PAÍSES BAJOS							
14.558	ASML Holding NV	3.308.306	3,20				
44.387	NXP Semiconductor NV	4.442.771	4,29				
34.990	Philips NV	1.487.075	1,44				
219.117	RELX plc	4.783.324	4,62				
34.980	Unilever NV	1.929.147	1,86				
72.018	Wolters Kluwer NV	4.823.766	4,66				
	Total de los Países Bajos	20.774.389	20,07				
SUECIA							
104.477	Atlas Copco AB - A	2.955.252	2,85				
	Total de Suecia	2.955.252	2,85				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado en GBP	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado en GBP	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente			
Renta variable				Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
JERSEY - ISLAS DEL CANAL				REINO UNIDO			
299.566	Breedon Group plc	195.617	2,00	900.000	United Kingdom Treasury Bill 0.00% 11/11/2019	899.354	9,17
	Total de Jersey - Islas del Canal	195.617	2,00	900.000	United Kingdom Treasury Bill 0.00% 18/11/2019	899.130	9,17
REINO UNIDO				Total del Reino Unido		1.798.484	18,34
34.441	Ascential plc	130.531	1,33	Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		1.798.484	18,34
3.000	Associated British Foods plc	69.090	0,70	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		1.798.484	18,34
2.714	Berkeley Group Holdings plc	113.418	1,16	Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
7.102	British American Tobacco plc	213.593	2,18	Fondos			
84.253	BT Group plc	150.459	1,53	IRLANDA			
9.316	Compass Group	194.984	1,99	755.695	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	755.695	7,71
9.913	Derwent London plc	334.068	3,41	Total de Irlanda		755.695	7,71
7.274	Diageo plc	242.442	2,47	Total de fondos		755.695	7,71
32.612	DS Smith plc	117.534	1,20	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		755.695	7,71
11.538	Glaxosmithkline plc	201.292	2,05	Valor total de las inversiones		8.310.855	84,77
14.316	Informa plc	121.972	1,25	(Coste total: GBP 7.743.868)			
10.325	Intermediate Capital Group plc	150.229	1,53				
89.850	ITV plc	113.121	1,15				
3.618	Johnson Matthey plc	110.602	1,13				
81.634	Legal & General Group plc	202.779	2,07				
4.496	London Stock Exchange Group plc	328.567	3,35				
5.495	Persimmon plc	119.242	1,21				
12.293	Prudential plc	181.322	1,85				
1.836	Reckitt Benckiser Group plc	116.476	1,19				
15.816	RELX plc	305.644	3,12				
73.754	Restaurant Group plc	104.878	1,07				
5.491	Rio Tinto plc	231.116	2,36				
13.225	Royal Dutch Shell plc - B	316.871	3,23				
9.454	Schroders plc	229.260	2,34				
5.287	Smith & Nephew plc	103.572	1,06				
14.865	SSP Group plc	92.163	0,94				
10.033	St James's Place plc	98.263	1,00				
158.693	Tesco plc	382.450	3,90				
4.404	Unilever plc	215.356	2,20				
80.490	Vodafone Group plc	130.394	1,33				
9.777	Weir Group plc	139.371	1,42				
	Total del Reino Unido	5.561.059	56,72				
	Total de renta variable	5.756.676	58,72				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	5.756.676	58,72				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable				Fondos			
PAÍSES BAJOS				IRLANDA			
27.897	NXP Semiconductor NV	3.044.121	2,72	5.091.146	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	5.091.146	4,55
Total de los Países Bajos		3.044.121	2,72	Total de Irlanda		5.091.146	4,55
ESTADOS UNIDOS				Total de fondos		5.091.146	4,55
13.858	Alexion Pharmaceuticals Inc.	1.357.253	1,21	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		5.091.146	4,55
8.123	Alphabet Inc. - A	9.919.320	8,87	Valor total de las inversiones		110.280.479	98,62
2.760	Amazon.com Inc.	4.791.112	4,29	(Coste total: USD 102.918.437)			
15.698	Analog Devices Inc.	1.753.938	1,57				
5.205	Apple Inc.	1.165.764	1,04				
130.972	Bank of America Corp.	3.820.453	3,42				
42.235	Berkshire Hathaway Inc.	8.785.725	7,86				
5.312	Biogen Idec Inc.	1.236.740	1,11				
38.466	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	2.592.607	2,31				
1.974	Booking Holdings Inc.	3.874.192	3,46				
235.533	Centennial Resource Development - A	1.063.432	0,95				
2.409	Curtiss-Wright Corp.	311.652	0,28				
12.839	Edwards Lifesciences Corp.	2.823.424	2,52				
24.526	Facebook Inc. - A	4.367.590	3,91				
1.471	Illumina Inc.	447.508	0,40				
53.141	JPMorgan Chase & Company	6.254.165	5,60				
6.412	L3Harris Technologies Inc.	1.337.800	1,19				
22.228	Lam Research Corp.	5.137.112	4,60				
20.636	Mastercard Inc. - A	5.604.119	5,01				
56.204	Microsoft Corp.	7.814.042	7,00				
21.237	Moderna Inc.	338.093	0,30				
30.554	Mondelez International Inc.	1.690.247	1,51				
20.016	Norfolk Southern Corp.	3.596.075	3,22				
78.433	Nutanix Inc. - A	2.058.866	1,84				
34.267	Phillips 66	3.508.940	3,13				
112.421	Uber Technologies Inc.	3.425.468	3,06				
11.848	UnitedHealth Group Inc.	2.574.807	2,30				
6.111	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.035.326	0,93				
31.739	Visa Inc. - A	5.459.425	4,88				
3.833	VMware Inc. - A	575.180	0,51				
11.812	Walt Disney Company	1.539.340	1,38				
178.045	WPX Energy Inc.	1.885.497	1,69				
Total de Estados Unidos		102.145.212	91,35				
Total de renta variable		105.189.333	94,07				
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		105.189.333	94,07				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
BERMUDAS				INDONESIA			
43.688	IHS Markit Limited	2.921.854	1,63	8.531.100	Bank Rakyat Indonesia	2.476.186	1,38
	Total de Bermudas	2.921.854	1,63		Total de Indonesia	2.476.186	1,38
CANADÁ				IRLANDA			
62.903	Suncor Energy Inc.	1.986.477	1,11	52.070	CRH plc	1.793.261	1,00
	Total de Canadá	1.986.477	1,11	22.477	Ingersoll-Rand plc	2.769.391	1,55
				17.761	Medtronic Inc.	1.929.200	1,08
ISLAS CAIMÁN					Total de Irlanda	6.491.852	3,63
18.584	Alibaba Group Holding Limited	3.107.802	1,74	JAPÓN			
85.600	Tencent Holdings Limited	3.605.527	2,02	12.100	Disco Corp.	2.290.686	1,28
	Total de las Islas Caimán	6.713.329	3,76	5.000	Keyence Corp.	3.095.072	1,73
CHINA				3.400	Nintendo Company Limited	1.259.014	0,70
52.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	597.317	0,33	31.300	Rohm Company Limited	2.389.312	1,34
	Total de China	597.317	0,33		Total de Japón	9.034.084	5,05
DINAMARCA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
50.843	Novo-Nordisk A/S	2.614.323	1,46	19.124	Ferguson plc	1.400.793	0,78
	Total de Dinamarca	2.614.323	1,46		Total de Jersey - Islas del Canal	1.400.793	0,78
FINLANDIA				PAÍSES BAJOS			
44.850	Upm-Kymmene Oyj	1.326.045	0,74	14.639	Lyondellbasell Industries NV - A	1.309.751	0,73
	Total de Finlandia	1.326.045	0,74	16.784	NXP Semiconductor NV	1.831.470	1,02
FRANCIA				118.539	RELX plc	2.821.118	1,58
13.113	EssilorLuxottica SA	1.890.619	1,06		Total de los Países Bajos	5.962.339	3,33
10.134	Pernod-Ricard SA	1.805.257	1,01	REPÚBLICA DE COREA (SUR)			
	Total de Francia	3.695.876	2,07	91.097	Samsung Electronics Company Limited	3.735.595	2,09
ALEMANIA					Total de la República de Corea (Sur)	3.735.595	2,09
11.800	Adidas AG	3.674.704	2,05	SUIZA			
	Total de Alemania	3.674.704	2,05	11.376	TE Connectivity Limited	1.060.016	0,59
HONG KONG					Total de Suiza	1.060.016	0,59
124.200	Aia Group Limited	1.173.180	0,66	REINO UNIDO			
	Total de Hong Kong	1.173.180	0,66	14.014	Aon plc	2.712.690	1,52
INDIA				22.720	Reckitt Benckiser Group plc	1.776.184	0,99
362.503	HDFC Bank Limited	6.278.750	3,52	38.253	Unilever plc	2.305.106	1,29
39.803	Matrimony.com Limited	334.497	0,19		Total del Reino Unido	6.793.980	3,80
	Total de India	6.613.247	3,71				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)				Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios			
Renta variable (continuación)				Fondos			
ESTADOS UNIDOS				IRLANDA			
58.436	Activision Blizzard Inc.	3.092.433	1,73	11.171.292	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	11.171.292	6,25
4.251	Adobe Inc.	1.174.339	0,66				
4.167	Alphabet Inc. - A	5.088.490	2,84		Total de Irlanda	11.171.292	6,25
3.597	Amazon.com Inc.	6.244.069	3,49				
20.989	Amphenol Corp.	2.025.438	1,14	Total de fondos		11.171.292	6,25
22.779	Baxter International Inc.	1.992.479	1,11				
3.323	Becton Dickinson & Company	840.586	0,47	Total de organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios		11.171.292	6,25
20.146	Berkshire Hathaway Inc.	4.190.771	2,34	Valor total de las inversiones		168.975.072	94,48
50.072	Centene Corp.	2.166.114	1,22				
34.541	Charles Schwab Corp.	1.444.850	0,81				
2.250	Charter Communications Inc. - A	927.270	0,52				
9.288	CME Group Inc.	1.962.926	1,10				
76.985	Comcast Corp.	3.470.484	1,94				
5.364	Cooper Companies Inc.	1.593.108	0,89				
47.829	Diamondback Energy Inc.	4.300.305	2,40				
11.412	Ecolab Inc.	2.260.033	1,27				
19.839	Electronic Arts Inc.	1.940.651	1,09				
32.181	Eog Resources Inc.	2.388.474	1,34				
3.235	Equinix Inc.	1.865.948	1,04				
13.622	Estee Lauder Companies Inc.	2.710.097	1,52				
131	Facebook Inc. - A	23.328	0,01				
15.070	Fidelity National Information Services Inc.	2.000.693	1,12				
49.055	Gilead Sciences Inc.	3.109.106	1,73				
42.577	Halliburton Company	802.576	0,45				
6.968	Illumina Inc.	2.119.805	1,19				
4.286	JPMorgan Chase & Company	504.419	0,28				
8.382	Lam Research Corp.	1.937.164	1,08				
10.995	Mastercard Inc. - A	2.985.912	1,67				
3.628	Microsoft Corp.	504.401	0,28				
19.011	Nvidia Corp.	3.309.245	1,85				
7.091	S&P Global Inc.	1.737.153	0,97				
48.039	Service Corp. International	2.296.745	1,28				
10.173	Transunion	825.132	0,46				
30.618	Trex Company Inc.	2.784.094	1,56				
3.982	Tyler Technologies Inc.	1.045.275	0,58				
33.592	Union Pacific Corp.	5.441.232	3,04				
6.030	UnitedHealth Group Inc.	1.310.440	0,73				
3.901	Vertex Pharmaceuticals Inc.	660.907	0,37				
25.906	Visa Inc. - A	4.456.091	2,49				
	Total de Estados Unidos	89.532.583	50,06				
	Total de renta variable	157.803.780	88,23				
	Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa	157.803.780	88,23				

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Valor nominal	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa			
Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda			
ESTADOS UNIDOS			
USD	500.000 United States Treasury Bill 0.00% 26/03/2020	495.537	0,13
Total de Estados Unidos		495.537	0,13
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		495.537	0,13
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		495.537	0,13

Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente

Autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda

ESTADOS UNIDOS			
USD	110.500.000 United States Treasury Bill 0.00% 07/11/2019	110.302.173	28,46
USD	106.500.000 United States Treasury Bill 0.00% 05/12/2019	106.152.341	27,39
USD	82.500.000 United States Treasury Bill 0.00% 30/01/2020	81.997.270	21,15
USD	67.500.000 United States Treasury Bill 0.00% 27/02/2020	66.992.056	17,28
USD	500.000 United States Treasury Bill 0.00% 23/04/2020	494.839	0,13
USD	500.000 United States Treasury Bill 0.00% 21/05/2020	494.134	0,13
Total de Estados Unidos		366.432.813	94,54
Total de autoridades públicas locales, supranacionales, gubernamentales e instrumentos de deuda		366.432.813	94,54
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otro mercado regulado y valores mobiliarios emitidos recientemente		366.432.813	94,54
Valor total de las inversiones		366.928.350	94,67

(Coste total: USD 365.015.663)

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

Estado de Cuentas de la Cartera

a 30 de septiembre de 2019

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo	Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa				Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable				Renta variable (continuación)			
AUSTRALIA				JERSEY - ISLAS DEL CANAL			
1.631	CSL Limited	257.066	1,97	1.258	Aptiv plc	109.974	0,84
	Total de Australia	257.066	1,97	3.528	Ferguson plc	258.419	1,98
CANADÁ					Total de Jersey - Islas del Canal	368.393	2,82
9.523	Suncor Energy Inc.	300.580	2,31	PAÍSES BAJOS			
	Total de Canadá	300.580	2,31	1.173	ASML Holding NV	290.609	2,23
DINAMARCA				1.956	NXP Semiconductor NV	213.439	1,64
5.939	Novo-Nordisk A/S	305.382	2,35		Total de los Países Bajos	504.048	3,87
1.128	Orsted A/S	104.852	0,80	ESPAÑA			
	Total de Dinamarca	410.234	3,15	6.503	Industria de Diseno Textil SA	201.344	1,54
FRANCIA					Total de España	201.344	1,54
1.528	EssilorLuxottica SA	220.305	1,69	SUECIA			
730	L'Oreal SA	204.453	1,57	3.623	Atlas Copco AB - A	111.725	0,85
	Total de Francia	424.758	3,26	5.978	Epiroc AB - A	64.874	0,50
ALEMANIA					Total de Suecia	176.599	1,35
985	Adidas AG	306.744	2,35	SUIZA			
1.995	BASF SE	139.458	1,07	1.131	Nestle SA - Reg	122.815	0,94
	Total de Alemania	446.202	3,42	3.055	Novartis AG - Reg	265.135	2,03
IRLANDA				1.040	Roche Holding AG	302.931	2,33
1.956	Ingersoll-Rand plc	240.999	1,85	660	Sika AG	96.635	0,74
813	Ryanair Holdings plc	53.967	0,41	1.970	TE Connectivity Limited	183.565	1,41
	Total de Irlanda	294.966	2,26		Total de Suiza	971.081	7,45
JAPÓN				REINO UNIDO			
4.800	Bridgestone Corp.	185.827	1,43	2.769	Rio Tinto plc	143.621	1,10
10.600	Capcom Company Limited	280.803	2,15	3.218	Unilever plc	193.915	1,49
2.400	Hoya Corp.	195.841	1,50		Total del Reino Unido	337.536	2,59
200	Keyence Corp.	123.803	0,95	ESTADOS UNIDOS			
3.300	Koito Manufacturing Company Limited	161.221	1,24	1.068	3M Company	175.579	1,35
4.500	Murata Manufacturing Company Limited	215.891	1,66	3.524	Activision Blizzard Inc.	186.490	1,43
1.500	Nidec Corp.	201.527	1,55	857	Adobe Inc.	236.746	1,82
700	Nintendo Company Limited	259.209	1,99	106	Alphabet Inc. - A	129.441	0,99
3.600	Pigeon Corp.	148.397	1,14	4.276	Applied Materials Inc.	213.372	1,64
1.900	Rohm Company Limited	145.038	1,11	2.314	Baxter International Inc.	202.406	1,55
8.600	Terumo Corp.	276.919	2,12	4.005	Boston Scientific Corp.	162.963	1,25
900	Tokyo Electron Limited	171.256	1,31	5.658	Bristol-Myers Squibb Company	286.917	2,20
4.800	Yaskawa Electric Corp.	176.100	1,35	617	Cooper Companies Inc.	183.249	1,41
	Total de Japón	2.541.832	19,50	2.093	Eog Resources Inc.	155.342	1,19
				1.048	Estee Lauder Companies Inc.	208.499	1,60
				743	Facebook Inc. - A	132.313	1,02

Las notas adjuntas forman parte integrante de estos estados financieros.

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

Estado de Cuentas de la Cartera

(continuación)

Cantidad	Inversión	Valor de mercado USD	% del valor liquidativo
Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa (continuación)			
Renta variable (continuación)			
ESTADOS UNIDOS (continuación)			
2.976	Gilead Sciences Inc.	188.619	1,45
5.818	Halliburton Company	109.669	0,84
778	Illumina Inc.	236.683	1,82
6.588	Microsoft Corp.	915.929	7,03
1.010	Mohawk Industries Inc.	125.311	0,96
1.183	PepsiCo Inc.	162.189	1,24
4.437	Pfizer Inc.	159.421	1,22
1.972	PTC Inc.	134.451	1,03
1.126	Salesforce.com Inc.	167.143	1,28
614	Stryker Corp.	132.808	1,02
354	Thermo Fisher Scientific Inc.	103.110	0,79
5.846	TJX Companies Inc.	325.856	2,50
1.808	Union Pacific Corp.	292.860	2,25
2.277	Valero Energy Corp.	194.091	1,49
Total de Estados Unidos		5.521.457	42,37
Total de renta variable		12.756.096	97,86
Total de valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos oficialmente a cotización en bolsa		12.756.096	97,86
Valor total de las inversiones		12.756.096	97,86
(Coste total: USD 11.748.882)			

Notas a los estados financieros

1 GENERAL

Threadneedle (Lux) (la «SICAV») es una sociedad de inversión con capital variable (Société d'Investissement à Capital Variable) regulada por la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010, relativa a los Organismos de inversión colectiva, en su versión modificada.

La SICAV ofrece a los inversores la oportunidad de invertir en subfondos separados (las «Carteras»), cada uno de los cuales tiene un objetivo de inversión diferente y es una cartera separada de activos representados por valores separados. Cada Cartera puede tener una o más clases de acciones (las «Clases de Acciones») relacionadas con ella. La SICAV en su conjunto, incluidas todas las Carteras actuales y todas las Carteras futuras, es una persona jurídica. Sin embargo, con respecto a terceros y, en particular, con respecto a los acreedores de la SICAV y entre Accionistas, cada Cartera será exclusivamente responsable de todos los pasivos que se le atribuyan.

Acontecimientos significativos durante el periodo:

Nuevo folleto

En junio de 2019 se publicó un nuevo Folleto.

Valor liquidativo (VL)

A partir del 1 de julio de 2019, el VL se publicó con cuatro decimales (antes dos).

Lanzamiento y cierre de Carteras

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond Portfolio lanzado el 18 de julio de 2019.

Con efecto a partir del 8 de mayo de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond Portfolio se puso en liquidación.

Con efecto a partir del 27 de mayo de 2019, Threadneedle (Lux) - Asian Focus Portfolio se puso en liquidación.

Cambio de denominación de la Clase de Acciones

A partir del 31 de julio de 2019, el nombre de la Clase de Acciones 9GP de Threadneedle (Lux) - UK Equity Income Portfolio ha cambiado a 9G.

Lanzamiento y cierre de Clases de Acciones

Las siguientes clases de acciones se lanzaron durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2019:

Clase de Acciones	Cartera	Fecha Efectiva
XGH	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	17 de mayo de 2019
4G	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	4 de abril de 2019
XE	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	18 de julio de 2019
AE	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
AEP	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
IE	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
IEP	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
IGC	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
IGH	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
XE	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
XGH	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
ZE	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18 de julio de 2019
IKH	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	13 de agosto de 2019
ZEP	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	25 de abril de 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	13 de agosto de 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	27 de junio de 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	27 de junio de 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	27 de junio de 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	27 de junio de 2019
IU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	22 de mayo de 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	27 de junio de 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	27 de junio de 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	13 de agosto de 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	13 de agosto de 2019
IEH	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	26 de junio de 2019
AUM	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	6 de septiembre de 2019
IU	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	22 de mayo de 2019
NE	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	3 de julio de 2019
AD	Threadneedle (Lux) - American Select	27 de junio de 2019
AN	Threadneedle (Lux) - American Select	27 de junio de 2019

Notas a los estados financieros

(continuación)

1 GENERAL

(continuación)

Clase de Acciones	Cartera	Fecha Efectiva
ID	Threadneedle (Lux) - American Select	27 de junio de 2019
IE	Threadneedle (Lux) - American Select	26 de junio de 2019
IN	Threadneedle (Lux) - American Select	27 de junio de 2019
IE	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	26 de junio de 2019
XU	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	17 de mayo de 2019
IE	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	26 de junio de 2019
IG	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	8 de mayo de 2019
IE	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	26 de junio de 2019
IE	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	26 de junio de 2019
XU	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	17 de mayo de 2019
9G	Threadneedle (Lux) - UK Equities	25 de abril de 2019
9G (anteriormente 9GP)	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	25 de abril de 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	27 de junio de 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	27 de junio de 2019
IU	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	22 de mayo de 2019

Las siguientes clases de acciones quedaron inactivas durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2019:

Clase de Acciones	Cartera	Fecha Efectiva
3EP	Threadneedle (Lux) - UK Equities	13 de agosto de 2019

A 30 de septiembre de 2019, las Carteras activas de la SICAV son las siguientes:

Las Carteras de bonos:

- Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Social Bond
- Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Las Carteras de asignación de activos:

- Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return¹
- Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income¹

Las Carteras de renta variable:

- Threadneedle (Lux) - Global Focus¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) - Global Select
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American¹
- Threadneedle (Lux) - American Select¹
- Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity¹
- Threadneedle (Lux) - Asia Equities
- Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income¹
- Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities¹
- Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income¹
- Threadneedle (Lux) - Global Technology¹

Notas a los estados financieros

(continuación)

1 GENERAL

(continuación)

- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

Las Carteras de rendimiento absoluto:

- Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha

Las Carteras de Extended Alpha:

- Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

La Cartera de especialistas:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities¹

La Cartera Shariah:

- Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

¹A 30 de septiembre de 2019, estas Carteras han sido autorizadas por la Comisión de Valores y Futuros en Hong Kong y están disponibles al público de Hong Kong.

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

Los estados financieros se preparan y presentan de acuerdo con los principios de contabilidad generalmente aceptados aplicables a los fondos de inversión de OICVM (Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios) en Luxemburgo y requieren que la administración haga estimaciones y supuestos que afecten a los importes declarados en los estados financieros y notas adjuntas. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones.

Los estados financieros se presentan sobre la base del Valor liquidativo de las Carteras, que se calcula a 30 de septiembre de 2019. El último Valor liquidativo oficial de las Carteras correspondientes se ha calculado a partir del 30 de septiembre de 2019.

Los estados financieros se preparan de conformidad con los requisitos legales y reglamentarios de Luxemburgo relativos a los fondos de inversión en régimen de empresa en funcionamiento, excepto en el caso de las Carteras Global Strategic Bond y Asian Focus. Como se indica en la Nota 1, estas Carteras se pusieron en liquidación durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2019. Como tal, los estados financieros de estas Carteras se han preparado sobre una base de empresa no consolidada.

Base contable de las empresas no consolidadas

Para las Carteras para las que los estados financieros han sido preparados sobre una base de empresa no consolidada, las siguientes políticas contables difieren de las descritas en las Notas 2 a 20:

- los gastos de liquidación previstos correrán a cargo de la Sociedad Gestora;
- el resto de los gastos de establecimiento se han cargado íntegramente; y
- la valoración de las inversiones de las Carteras se basa en su valor neto realizable.

La aplicación de la base contable de empresa no consolidada no ha dado lugar a ajustes significativos en el Valor liquidativo publicado de las Carteras.

1) Valoración de valores

Los valores transferibles, los instrumentos del mercado monetario y cualquier activo financiero listado o negociado en un mercado regulado se valoran a su último precio de cambio en el mercado correspondiente en el momento del cierre del mercado. Si dichos precios no son representativos de su valor justo de mercado, dichos valores se expresan según el valor razonable al que se espera que puedan revenderse, según lo determine de buena fe el Consejo de Administración o bajo su dirección.

Los valores de renta fija que no se negocian en dichos mercados se valoran al último precio disponible o rendimiento equivalente obtenido de uno o más distribuidores o servicios de fijación de precios aprobados por el Consejo de Administración, o cualquier otro precio que el Consejo de Administración considere apropiado.

Los Instrumentos del mercado monetario (u otros instrumentos en línea con la convención de mercado en la jurisdicción en la que se mantiene el instrumento) con un vencimiento restante de 90 días o menos se valorarán según el método de coste amortizado, que se aproxima al valor de mercado. Bajo este método de valoración, las inversiones de la Cartera correspondiente se valoran a su coste de adquisición o al último valor de mercado antes del periodo de 90 días (en que un instrumento en la fecha de compra originalmente tenía más de 90 días hasta el vencimiento) y se ajusta para la amortización de la prima o acumulación de descuento en lugar de al valor de mercado.

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

Las participaciones o acciones de organismos de inversión colectiva («OIC») abiertos se valoran a su último valor liquidativo determinado y disponible (el «Valor liquidativo») o, si dicho precio no es representativo del valor justo de mercado de tales activos, entonces el precio será determinado por la SICAV, de manera justa y equitativa. Las participaciones o acciones de OIC cerrados se valoran a su último valor de mercado de valores disponible.

Los consejeros de la SICAV (los «Consejeros»), a su discreción, pueden permitir el uso de algún otro método de valoración si consideran que dicha valoración refleja mejor el valor razonable de cualquier activo de la SICAV.

II) Contratos de divisas a plazo

Con el fin de protegerse contra el riesgo de cambio específico o invertir en otras divisas, la SICAV podrá celebrar contratos de divisas a plazo. Al final del año, los contratos abiertos de divisas a plazo se valoran a los tipos a plazo aplicables para el periodo restante hasta el vencimiento. El movimiento neto en la ganancia/(pérdida) no realizada que surge de los contratos de divisas a plazo se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 30 de septiembre de 2019 figuran en la Nota 9.

III) Contratos de futuros

La SICAV podrá celebrar contratos de futuros. Los contratos de futuros abiertos se valoran a los precios en la bolsa para la cual se negocian los contratos. El movimiento neto en la ganancia/(pérdida) no realizada que surge de los contratos de futuros se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 30 de septiembre de 2019 figuran en la Nota 11.

IV) Operaciones de swaps

La SICAV podrá participar en Swaps de tipos de interés («IRS»), Swaps de incumplimiento crediticio («CDS») y Swaps de rendimiento total («SRT»). Los IRS se valoran sobre la base de su valor de mercado establecido por referencia a la curva del tipo de interés aplicable. Los CDS se valoran por referencia al valor presente neto de los flujos de efectivo futuros esperados según los tipos de interés del mercado y la tasa de incumplimiento y recuperación esperada del mercado del activo subyacente. Un pago por adelantado, si lo hubiere, realizado por la SICAV se registra como un activo en el Estado en el patrimonio neto. Un pago por adelantado, si lo hubiera, recibido por la SICAV se registra como un pasivo en el Estado en el patrimonio neto. Los SRT se valoran por referencia a la marca al valor de mercado en función del valor de mercado del activo subyacente. El movimiento neto en la ganancia o pérdida no realizada que surge de las operaciones de swap se registra en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto. Los contratos vigentes a 30 de septiembre de 2019 figuran en la Nota 10. Los dividendos a pagar en swaps de posiciones cortas, si existen, se registran como un pasivo en el Estado en el patrimonio neto.

V) Transacciones de opciones

Las opciones negociadas en un mercado regulado se valoran al precio de mercado en la fecha de valoración. Dichas opciones abiertas a 30 de septiembre de 2019 se muestran en el Programa de inversiones. Las opciones de venta libre («OTC») se valoran según los precios recibidos de los agentes o modelos de precios de terceros. Dichas opciones abiertas a 30 de septiembre de 2019 se muestran en la Nota 12. Las ganancias o pérdidas no realizadas que surgen en el momento de la presentación de informes de la valoración de las operaciones con opciones se tienen en cuenta en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto.

VI) Conversión de divisas

Las cuentas de cada Cartera se mantienen en la divisa en que se expresa su patrimonio neto. El Estado en el patrimonio neto, el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto y el Programa de inversiones correspondientes se expresan en esta divisa (la «divisa base»).

Durante el periodo, las transacciones, los ingresos y los gastos denominados en una divisa distinta de la divisa base se registran sobre la base de los tipos de cambio vigentes en la fecha en que ocurren o se acumulan en la Cartera.

En la fecha del Estado en el patrimonio neto, los activos y pasivos monetarios denominados en una divisa distinta a la divisa base se convierten a la divisa base en función de los tipos de cambio vigentes en esa fecha. Las diferencias de cambio se incluyen en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto.

El Estado en el patrimonio neto y el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto se presentan en USD en función de los tipos de cambio vigentes en la fecha del Estado en el patrimonio neto. Los tipos de cambio utilizados a 30 de septiembre de 2019 son: 1 USD = 1,482690 AUD, 1 USD = 0,917263 EUR, 1 USD = 0,811491 GBP, 1 USD = 0,997150 CHF, 1 USD = 9,832165 SEK, 1 USD = 6,848565 DKK, 1 USD = 9,085953 NOK y 1 USD = 1,382900 SGD.

La diferencia entre el patrimonio neto de apertura declarado a los tipos de cambio vigentes al inicio del periodo y su valor al final del periodo se muestra como un ajuste de conversión de moneda en el Estado consolidado de operaciones y cambios en el patrimonio neto según el encabezamiento Diferencias de cambio.

Notas a los estados financieros

(continuación)

2 RESUMEN DE POLÍTICAS CONTABLES SIGNIFICATIVAS

(continuación)

VII) Dinero en efectivo en el banco

El dinero efectivo en el banco reflejado en los Estados en el patrimonio neto incluye también los márgenes sobre los futuros y las garantías en efectivo debidas por los intermediarios para las transacciones de swaps y los contratos de divisas a plazo.

El efectivo y los márgenes sobre los futuros se valoran a precio de coste, que se aproxima al valor de mercado.

VIII) Depósitos a plazo

Los depósitos a plazo se valoran a precio de coste, que se aproxima al valor de mercado.

IX) Transacciones de inversión e ingresos por inversiones

Los valores se registran a precio de coste y, cuando corresponda, en función de los tipos de cambio vigentes en la fecha de compra.

Los resultados sobre las ventas de valores se determinan en función del método del coste promedio. Las transacciones de inversión se contabilizan en la fecha de transacción. Los dividendos se contabilizan en el periodo ex-dividendo. Los ingresos por intereses se registran en valores devengados. Los descuentos o primas en bonos con cupón cero se acumulan como ajustes a los ingresos por intereses.

Los intereses, dividendos y ganancias de capital en valores podrán estar sujetos a retenciones o impuestos a las ganancias de capital en ciertos países.

X) Política de distribución

La política de la SICAV con respecto a todas las Clases de Acciones de Carteras, con excepción de las Clases cuya denominación termina en «C», «M», «P» o «T» es no hacer distribuciones, acumular en dichas Carteras todas las ganancias netas y reinvertirlas dentro de la misma Cartera y Clase. Con respecto a las Clases cuya denominación termina en «C», «M», «P» o «T», la SICAV pretende hacer distribuciones, con una frecuencia, al menos una vez al año, y en una cantidad que determinarán los Consejeros. Los Accionistas de estas Clases de Acciones tienen la opción de recibir el dividendo o reinvertirlo en la SICAV.

XI) Reembolsos de comisiones de gestión de activos

Las inversiones cruzadas y las inversiones en otros fondos de Columbia Threadneedle se realizan en clases de acciones sin pago de comisiones, o cualquier comisión de administración pagada se reembolsa por completo. Consulte también la Nota 18 para obtener detalles sobre las inversiones cruzadas.

3 FISCALIDAD

De acuerdo con las leyes y prácticas actuales, la SICAV no está sujeta a ningún impuesto sobre la renta de Luxemburgo ni a las ganancias de capital de Luxemburgo sobre la apreciación del capital realizada de los activos de la SICAV, ni los dividendos pagados por la SICAV están sujetos a ningún impuesto retenido de Luxemburgo.

De conformidad con la legislación y los reglamentos vigentes, la SICAV está sujeta, en el Gran Ducado de Luxemburgo, a un impuesto de suscripción anual del 0,05%, pagadero trimestralmente y evaluado sobre su Valor liquidativo al final de cada trimestre. No se adeudan impuestos sobre los activos mantenidos por la SICAV en otros OICVM ya sujetos a ese impuesto en Luxemburgo.

Con respecto a las Clases de Acciones Institucionales, se aplica un impuesto de suscripción anual reducido del 0,01% sobre el Valor liquidativo el último día de cada trimestre de conformidad con la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada.

Además, aquellas carteras cuyo único objeto es la inversión colectiva en instrumentos del mercado monetario y la colocación de depósitos en entidades de crédito también están sujetas a un impuesto reducido del 0,01%. Nuevamente, no se adeuda dicho impuesto sobre la parte de los activos de la SICAV invertidos en otros OICVM de Luxemburgo, si lo hubiere.

Si bien las ganancias de capital realizadas de la SICAV no están sujetas a impuestos en Luxemburgo, ya sea a corto o largo plazo, estas ganancias de capital realizadas podrán estar sujetas a impuestos en los países de origen.

4 COMISIONES VARIAS

Las comisiones varias se componen principalmente de comisiones por cambio de divisas, de impuestos italianos, ajustes de dilución y retención de impuestos sobre los ingresos de derivados. En Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity Portfolio, las comisiones varias se componen de la cantidad de ingresos impuros que se donarán.

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

La SICAV puede, en nombre de las diferentes Carteras, suscribir acuerdos de endeudamiento (sujeto a las restricciones establecidas en «Restricciones de inversión» en el Apéndice A del Folleto) con, y comprar o vender valores transferibles, divisas u otros instrumentos financieros a través de Threadneedle Asset Management Limited («TAML»), una entidad relacionada y sus filiales, siempre que dichas transacciones se realicen en términos comerciales normales y sean en el mejor interés de la Cartera correspondiente y sus Accionistas.

Para el periodo que finaliza el 30 de septiembre de 2019, la SICAV no realizó transacciones con personas relacionadas.

La SICAV ha nombrado a Threadneedle Management Luxembourg S.A. (la «Sociedad Gestora») para que actúe como su sociedad gestora designada de conformidad con el Capítulo 15 de la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada. En virtud del Acuerdo de Servicios de la Sociedad Gestora, la Sociedad Gestora proporciona servicios de gestión de inversiones, administrativos y de marketing a la SICAV, sujeto a la supervisión y el control generales del Consejo de Administración.

Ni la Sociedad Gestora ni TAML obtuvieron comisiones relacionadas con las transacciones de corretaje.

Algunos funcionarios y/o consejeros de la Sociedad Gestora, la SICAV y otras entidades del Grupo Columbia Threadneedle también son funcionarios y/o consejeros de TAML.

La Sociedad Gestora (en nombre de la SICAV) ha delegado ciertas funciones de comercialización y/o distribución a otras entidades del Grupo Columbia Threadneedle. La Sociedad Gestora recibe una tarifa mensual por los servicios de gestión de activos a una tasa anual que se detalla en esta nota, expresada como un porcentaje del patrimonio neto diario promedio para cada una de las Carteras. La Sociedad Gestora es responsable de pagar las comisiones de subdistribución de esta comisión. Algunos de los subasesores son entidades relacionadas.

Como se describe en la Nota 8, la Sociedad Gestora también puede recibir comisiones de rendimiento con respecto a todas las Acciones A, D, I y Z de Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, con respecto a todas las Acciones J e Y de Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio, con respecto a todas las Acciones A, D, I, L y Z de Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio, con respecto a todas las Acciones A, D, I, Z, 2 y 9 de Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha, con respecto a todas las Acciones A, D, I, Z, 2 y 9 de Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha, y con respecto a todas las Acciones A, D, I, Z y 2 de Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha.

Todos los gastos incurridos en el funcionamiento de la SICAV y definidos a continuación (en adelante, «Otros Gastos operativos», «Comisión de gestión de activos» o «Cargos de Cartera», juntos, los «Gastos») se fijan a las tasas mostradas en las tablas de la página 213. Todos los gastos se acumulan diariamente en función del Valor liquidativo de la Clase de Acciones correspondiente en la Cartera correspondiente.

Los Gastos operativos incluyen, entre otras cosas, impuestos, gastos por servicios legales y de auditoría, costes de impresión de apoderados, certificados de acciones, informes y avisos de los accionistas, folletos y documentos de información clave para el inversor y otros gastos promocionales, tarifas y cargos del depositario y sus corresponsales, y del agente domiciliario, agente administrativo, de registrador y agente de transferencias y de cualquier agente pagador, gastos de emisión y reembolso de acciones, tarifas de registro y gastos en diversas jurisdicciones, comisiones de cotización, comisiones de consejeros no afiliados de la SICAV, gastos de los Consejeros y funcionarios de la SICAV y de los subconsejeros relacionados con la asistencia a las reuniones de los Consejeros y de los accionistas de la SICAV, costes de traducción, costes de contabilidad y precios (incluido el cálculo del Valor liquidativo por acción), seguros, litigios y otros gastos extraordinarios o no recurrentes, y todos los demás gastos pagaderos adecuadamente por la SICAV. Los Gastos operativos también incluyen la comisión de servicio a pagar a la Sociedad Gestora. La Sociedad Gestora soportará el exceso de cualquier gasto operativo por encima de la tasa anual. En cambio, la Sociedad Gestora tendrá derecho a retener cualquier cantidad en la cual la tasa anual de Gastos operativos exceda los gastos reales incurridos por la SICAV.

Además, la Sociedad Gestora tiene derecho a recibir una comisión de gestión de activos (la «Comisión de gestión de activos») tal como se describe más detalladamente en las tablas de la página 213 en adelante que se acumulan diariamente y se pagan mensualmente. Una Comisión de gestión de activos no es pagadera por Acciones X. Para evitar dudas, los Gastos operativos no incluyen las Comisiones de gestión de activos ni las comisiones de rendimiento que son separadas y distintas.

La SICAV podrá ofrecer Acciones B en ciertas Carteras. Las Acciones B no tienen coste de venta inicial y están sujetas a una comisión de distribución continua del 1,00% del Valor liquidativo total de la Clase anual.

Las Acciones B de Threadneedle (Lux) - Global Technology son una Clase de Acciones heredada disponible solo para su suscripción posterior por los Accionistas actuales.

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

ACCIONES A:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Carteras de bonos	Máximo 3,0%	Máximo 0,75%
Carteras de renta variable y Carteras de asignación de activos	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%
Carteras de rendimiento absoluto	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%
Carteras de Extended Alpha	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%
Cartera de especialistas	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%
Cartera de la Shariah	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	0,90%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,90%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	0,75%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,25%	0,30%	USD
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	1,25%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,35%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25%	0,30%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,55%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50%	0,30%	GBP

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	1,50%	0,30%	GBP
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50%	0,30%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,75%	0,30%	USD
Cartera de la Shariah				
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	1,50%	0,35%	USD

ACCIONES B:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	Nulo

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de Renta Variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00%	0,35%	USD

ACCIONES D:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 1,00%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	1,35%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,45%	0,30%	USD
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	2,00%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset income	2,00%	0,30%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00%	0,30%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de renta variable (continuación)				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,85%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25%	0,35%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25%	0,30%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	2,00%	0,30%	GBP
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00%	0,30%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	2,25%	0,30%	USD

ACCIONES I:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	Máximo 0,75%

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,65%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	0,40%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,60%	0,20%	USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de asignación de activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,65%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75%	0,20%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65%	0,20%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65%	0,20%	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25%	0,35%	USD
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	0,75%	0,20%	GBP
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80%	0,20%	USD

ACCIONES J:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	Máximo 0,75%

También se pagará una comisión de rendimiento para las Acciones J, según se describe en la sección titulada «Comisión de rendimiento» en el texto principal del Folleto.

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de Rendimiento Absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25%	0,20%	EUR

ACCIONES L:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	0,75%

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
Cartera de Asignación de Activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,50%	0,20%	EUR
Cartera de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50%	0,20%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,20%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,375%	0,20%	EUR

ACCIONES N:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	0,75%

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30%	0,10%	EUR
Cartera de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,55%	0,20%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45%	0,20%	USD

ACCIONES S:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50%	0,30%	USD

ACCIONES T:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	5,00%	0,75%

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de bonos				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55%	0,10%	USD
Cartera de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,90%	0,19%	USD

ACCIONES W:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 5,0%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,85%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00%	0,30%	USD
Cartera de Asignación de Activos				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40%	0,35%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,40%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65%	0,35%	USD

ACCIONES X:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	Máximo 0,75%

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos			
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,15%	USD
Carteras de renta variable			
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,15%	USD
Carteras de rendimiento absoluto			
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15%	EUR
Cartera de especialistas			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,15%	USD
Cartera de la Shariah			
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	0,25%	USD

ACCIONES Y:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	5,00%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de Rendimiento Absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35%	0,25%	EUR

ACCIONES Z:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	5,00%	Máximo 0,75%

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,60%	0,30%	USD
Cartera de Asignación de Activos				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75%	0,30%	USD
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,25%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75%	0,35%	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,30%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,35%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,30%	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25%	0,35%	USD
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,55%	0,25%	EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45%	0,25%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75%	0,30%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	0,75%	0,30%	GBP
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,30%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,30%	USD
Cartera de especialistas				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75%	0,30%	USD

ACCIONES DE CLASE 1:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	5,00%	N/A

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	1,00%	0,19%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,20%	0,18%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50%	0,21%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,50%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,50%	0,17%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50%	0,17%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,50%	0,23%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50%	0,20%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,50%	0,22%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,50%	0,22%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50%	0,14%	GBP
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00%	0,17%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	1,50%	0,18%	GBP
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50%	0,19%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50%	0,19%	USD

ACCIONES DE CLASE 2:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	N/A

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75%	0,07%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00%	0,07%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00%	0,07%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00%	0,06%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00%	0,06%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00%	0,07%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00%	0,09%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,00%	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00%	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00%	0,07%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00%	0,06%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00%	0,07%	EUR
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,06%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	1,00%	0,07%	GBP
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,08%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,08%	USD

ACCIONES DE CLASE 3:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	Máximo 3,00%	N/A

Los costes de venta son los máximos, a que los distribuidores o subdistribuidores podrán renunciar en todo o en parte, según el tamaño de la suscripción o las consideraciones del mercado local.

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,19%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,17%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,15%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,13%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,12%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,18%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,20%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75%	0,19%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,20%	EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,16%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,13%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,18%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,12%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,13%	GBP
Cartera de Rendimiento Absoluto				
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	0,75%	0,18%	GBP
Cartera de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,19%	USD

ACCIONES DE CLASE 4:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	N/A

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Gastos operativos	Divisa base
Cartera de bonos			
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,07%	EUR
Carteras de renta variable			
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,08%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,07%	EUR
Cartera de Rendimiento Absoluto			
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,06%	EUR

ACCIONES DE CLASE 8:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	N/A

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75%	0,11%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00%	0,10%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00%	0,13%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,00%	0,12%	EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

5 TRANSACCIONES DE PARTES RELACIONADAS

(continuación)

	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00%	0,13%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00%	0,11%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00%	0,11%	EUR
Carteras de rendimiento absoluto				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50%	0,10%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	1,00%	0,11%	GBP
Carteras de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,12%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75%	0,12%	USD

ACCIONES DE CLASE 9:

Cartera(s)	Coste de venta inicial como % de la cantidad invertida	Comisión de cambio
Todas las Carteras enumeradas a continuación	N/A	N/A

Tipo de Cartera	Nombre de la Cartera	Comisión de gestión de activos	Gastos operativos	Divisa base
Carteras de bonos				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60%	0,13%	EUR
Carteras de renta variable				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75%	0,11%	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75%	0,09%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75%	0,08%	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75%	0,14%	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75%	0,16%	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75%	0,15%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75%	0,16%	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75%	0,12%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75%	0,09%	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75%	0,14%	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75%	0,08%	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75%	0,09%	GBP
Cartera de Rendimiento Absoluto				
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	0,75%	0,14%	GBP
Cartera de Extended Alpha				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75%	0,15%	USD

* Consulte la nota 1.

6 ACUERDOS DE REPARTO DE LA COMISIÓN

La Sociedad Gestora y algunos Subconsejeros podrán celebrar acuerdos de reparto de comisiones con corredores-agentes en virtud de los cuales determinados los servicios comerciales se obtienen directamente de dichos intermediarios o de terceros y son pagados por los intermediarios con cargo a las comisiones que ellos mismos perciben en operaciones para la SICAV. En consonancia con la obtención de la mejor ejecución, las comisiones de corretaje sobre las operaciones de cartera de la SICAV pueden ser las siguientes asignados específicamente por la Sociedad Gestora o cada uno de los Subconsejeros pertinentes a los en consideración de los servicios de investigación prestados, así como por los servicios prestados en la ejecución de

Notas a los estados financieros

(continuación)

órdenes por dichos corredores-agentes. En la sección del Folleto Informativo se detalla información adicional sobre las prácticas de cada Subconsejero con respecto a los acuerdos de participación en las comisiones, con el encabezamiento «Acuerdos de Asesoramiento de Inversiones».

Cualquier acuerdo de reparto de comisiones suscrito por la Sociedad Gestora o un Subasesor Subconsejero operará bajo las siguientes condiciones: (i) la Sociedad Gestora o el Subconsejero actuarán en todo momento en interés de la SICAV y de sus Accionistas cuando celebren acuerdos de reparto de comisiones; (ii) los servicios prestados estarán directamente relacionados con las actividades de la Sociedad Gestora o del Subconsejero; (iii) las comisiones de corretaje sobre las operaciones de cartera de la SICAV serán asignadas por la Sociedad Gestora o el Subconsejero a los corredores-agentes que sean entidades y no a personas físicas; (iv) los acuerdos de reparto de comisiones no serán un factor determinante en la selección de los corredores-agentes; (v) la Sociedad Gestora o el Subconsejero presentarán informes a los Consejeros con respecto a los acuerdos de reparto de comisiones, incluida la naturaleza de los servicios; (vi) ni la Sociedad Gestora, ni el Subconsejero ni ninguna de sus personas vinculadas podrán retener reembolsos en efectivo o de otro tipo por parte de los intermediarios; (vii) los bienes o servicios recibidos sean de beneficio demostrable para los Accionistas; y (viii) la divulgación periódica se hará en el informe anual de la SICAV en forma de declaración en la que se describa cualquier acuerdo de reparto de comisiones, incluida una descripción de los bienes o servicios recibidos. Los bienes y servicios recibidos pueden incluir: investigación que pueda agregar valor al proceso de toma de decisiones de un Subconsejero y servicios de ejecución que mejoren la capacidad del Subconsejero para ejecutar transacciones.

Solo los Subconsejeros Columbia Management Investment Advisors, LLC y STANLIB Asset Management Limited pueden celebrar acuerdos de reparto de comisiones.

7 DIVIDENDOS

La SICAV declaró los siguientes dividendos durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2019:

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa	Importe por Acción	Importe total
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	Clase DEC	24/04/2019	USD	0,021	68
					68 USD
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Clase AEC	24/06/2019	USD	0,069	2.098
	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,092	7.789
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,092	23
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,091	665
	Clase DEC	24/06/2019	USD	0,085	8
	Clase DEC	24/09/2019	USD	0,084	8
	Clase DUP	24/06/2019	USD	0,082	8
	Clase DUP	24/09/2019	USD	0,081	8
	Clase IEC	24/06/2019	USD	0,091	9
	Clase IEC	24/09/2019	USD	0,088	9
	Clase IEP	24/06/2019	USD	0,098	10
	Clase IEP	24/09/2019	USD	0,096	10
	Clase IGC	24/06/2019	USD	0,105	11
	Clase IGC	24/09/2019	USD	0,098	10
	Clase IUP	24/06/2019	USD	0,083	8
	Clase IUP	24/09/2019	USD	0,083	8
	Clase NEC	24/06/2019	USD	0,091	9
	Clase NEC	24/09/2019	USD	0,088	9
	Clase NGC	24/06/2019	USD	0,103	98.518
	Clase NGC	24/09/2019	USD	0,088	111.557
	Clase NUP	24/06/2019	USD	0,083	8
	Clase NUP	24/09/2019	USD	0,083	8
					220.791 USD
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Clase 1UT	24/04/2019	EUR	0,035	15.560
	Clase 1UT	23/05/2019	EUR	0,031	14.030
	Clase 1UT	24/06/2019	EUR	0,033	14.614
	Clase 1UT	25/07/2019	EUR	0,035	13.667
	Clase 1UT	23/08/2019	EUR	0,030	11.443
	Clase 1UT	24/09/2019	EUR	0,033	12.955
					82.269 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa	Importe por Acción	Importe total
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Clase IEP	24/06/2019	EUR	0,038	73.070
	Clase IEP	24/09/2019	EUR	0,037	73.455
	Clase NEP	24/06/2019	EUR	3,738	112.301
	Clase NEP	24/09/2019	EUR	3,705	111.715
	Clase ZEP	24/06/2019	EUR	0,023	2
	Clase ZEP	24/09/2019	EUR	0,036	1.617
					372.160 EUR
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Clase AEP	24/04/2019	EUR	0,025	9.395
	Clase AEP	23/05/2019	EUR	0,025	9.563
	Clase AEP	24/06/2019	EUR	0,025	9.710
	Clase AEP	25/07/2019	EUR	0,025	9.536
	Clase AEP	23/08/2019	EUR	0,025	9.483
	Clase AEP	24/09/2019	EUR	0,025	9.299
	Clase DEP	24/04/2019	EUR	0,019	7.486
	Clase DEP	23/05/2019	EUR	0,019	7.527
	Clase DEP	24/06/2019	EUR	0,019	7.709
	Clase DEP	25/07/2019	EUR	0,019	7.989
	Clase DEP	23/08/2019	EUR	0,019	8.841
	Clase DEP	24/09/2019	EUR	0,019	9.134
					105.672 EUR
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Clase AEC	24/04/2019	USD	0,065	24.118
	Clase AEC	23/05/2019	USD	0,065	23.649
	Clase AEC	24/06/2019	USD	0,066	23.877
	Clase AEC	25/07/2019	USD	0,065	24.586
	Clase AEC	23/08/2019	USD	0,064	25.239
	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,062	24.139
	Clase AUP	24/04/2019	USD	0,036	27.485
	Clase AUP	23/05/2019	USD	0,036	27.389
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,036	27.593
	Clase AUP	25/07/2019	USD	0,036	27.422
	Clase AUP	23/08/2019	USD	0,036	26.906
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,035	27.797
	Clase DEC	24/04/2019	USD	0,047	2.336
	Clase DEC	23/05/2019	USD	0,047	2.266
	Clase DEC	24/06/2019	USD	0,048	2.365
	Clase DEC	25/07/2019	USD	0,047	2.328
	Clase DEC	23/08/2019	USD	0,047	2.315
	Clase DEC	24/09/2019	USD	0,044	2.188
	Clase XUP	24/06/2019	USD	0,158	16
	Clase XUP	24/09/2019	USD	0,157	16
					324.030 USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	Clase AEC	24/04/2019	USD	0,054	5.748
	Clase AEC	23/05/2019	USD	0,054	5.810
	Clase AEC	24/06/2019	USD	0,054	5.865
	Clase AEC	25/07/2019	USD	0,053	5.494
	Clase AEC	23/08/2019	USD	0,053	5.536
	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,052	5.158

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa	Importe por Acción	Importe total
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt					
(continuación)	Clase AUP	24/04/2019	USD	0,057	227.813
	Clase AUP	23/05/2019	USD	0,057	226.178
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,057	222.544
	Clase AUP	25/07/2019	USD	0,057	219.754
	Clase AUP	23/08/2019	USD	0,057	217.752
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,057	216.044
	Clase SUP	24/04/2019	USD	0,054	3.928
	Clase SUP	23/05/2019	USD	0,054	3.928
	Clase SUP	24/06/2019	USD	0,055	3.991
	Clase SUP	25/07/2019	USD	0,055	3.740
	Clase SUP	23/08/2019	USD	0,055	3.440
	Clase SUP	24/09/2019	USD	0,055	3.394
	Clase XUP	24/06/2019	USD	0,168	17
	Clase XUP	24/09/2019	USD	0,171	17
					1.386.151 USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds					
	Clase AEC	24/04/2019	USD	0,031	35.098
	Clase AEC	23/05/2019	USD	0,031	35.678
	Clase AEC	24/06/2019	USD	0,032	36.180
	Clase AEC	25/07/2019	USD	0,031	35.213
	Clase AEC	23/08/2019	USD	0,031	34.808
	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,030	32.685
	Clase ASC	24/04/2019	USD	0,027	1.359
	Clase ASC	23/05/2019	USD	0,027	1.254
	Clase ASC	24/06/2019	USD	0,027	1.349
	Clase ASC	25/07/2019	USD	0,027	1.375
	Clase ASC	23/08/2019	USD	0,027	1.328
	Clase ASC	24/09/2019	USD	0,026	1.439
	Clase AUP	24/04/2019	USD	0,029	152.439
	Clase AUP	23/05/2019	USD	0,029	161.177
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,029	130.798
	Clase AUP	25/07/2019	USD	0,029	129.645
	Clase AUP	23/08/2019	USD	0,029	130.233
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,028	123.095
	Clase XUP	24/04/2019	USD	0,048	5
	Clase XUP	23/05/2019	USD	0,048	5
	Clase XUP	24/06/2019	USD	0,049	30.147
	Clase XUP	25/07/2019	USD	0,049	30.147
	Clase XUP	23/08/2019	USD	0,049	30.216
	Clase XUP	24/09/2019	USD	0,048	30.097
					1.165.770 USD
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond					
	Clase AEC	24/04/2019	USD	0,063	4.096
	Clase AEC	23/05/2019	USD	0,062	4.149
	Clase AEC	24/06/2019	USD	0,065	4.287
	Clase AEC	25/07/2019	USD	0,064	4.455
	Clase AEC	23/08/2019	USD	0,063	4.430
	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,059	4.125
	Clase AUP	24/04/2019	USD	0,058	21.250
	Clase AUP	23/05/2019	USD	0,058	20.919

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa	Importe por Acción	Importe total
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,059	21.191
	Clase AUP	25/07/2019	USD	0,059	19.498
	Clase AUP	23/08/2019	USD	0,059	19.127
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,057	18.280
	Clase DEC	24/04/2019	USD	0,048	2.538
	Clase DEC	23/05/2019	USD	0,048	2.526
	Clase DEC	24/06/2019	USD	0,049	2.343
	Clase DEC	25/07/2019	USD	0,048	2.306
	Clase DEC	23/08/2019	USD	0,048	2.293
	Clase DEC	24/09/2019	USD	0,045	1.691
	Clase IEC	24/04/2019	USD	0,045	2.025
	Clase IEC	23/05/2019	USD	0,045	2.142
	Clase IEC	24/06/2019	USD	0,046	2.181
	Clase IEC	25/07/2019	USD	0,046	2.146
	Clase IEC	23/08/2019	USD	0,045	1.785
	Clase IEC	24/09/2019	USD	0,043	593
	Clase XUP	24/06/2019	USD	0,156	16
	Clase XUP	24/09/2019	USD	0,161	16
					170.408 USD
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Clase ASC	24/04/2019	USD	0,027	235
	Clase ASC	23/05/2019	USD	0,026	232
	Clase ASC	24/06/2019	USD	0,027	236
	Clase ASC	25/07/2019	USD	0,026	235
	Clase ASC	23/08/2019	USD	0,026	303
	Clase ASC	24/09/2019	USD	0,025	297
	Clase AUP	24/04/2019	USD	0,037	257
	Clase AUP	23/05/2019	USD	0,037	257
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,038	264
	Clase AUP	25/07/2019	USD	0,038	215
	Clase AUP	23/08/2019	USD	0,038	215
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,036	218
	Clase AVC	24/04/2019	USD	0,024	2
	Clase AVC	23/05/2019	USD	0,023	2
	Clase AVC	24/06/2019	USD	0,024	2
	Clase AVC	25/07/2019	USD	0,024	2
	Clase AVC	23/08/2019	USD	0,024	2
	Clase AVC	24/09/2019	USD	0,023	2
	Clase ZUP	24/04/2019	USD	0,035	4
	Clase ZUP	23/05/2019	USD	0,035	4
	Clase ZUP	24/06/2019	USD	0,036	4
	Clase ZUP	25/07/2019	USD	0,036	4
	Clase ZUP	23/08/2019	USD	0,036	4
	Clase ZUP	24/09/2019	USD	0,034	3
					2.999 USD
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Clase AEP	24/09/2019	EUR	0,012	580
	Clase IEP	24/09/2019	EUR	0,013	628
	Clase LEP	24/09/2019	EUR	0,013	628
	Clase ZEP	24/09/2019	EUR	0,012	580
					2.416 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa	Importe por Acción	Importe total
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Clase AEC	24/04/2019	USD	0,016	2.615
	Clase AEC	23/05/2019	USD	0,016	2.463
	Clase AEC	24/06/2019	USD	0,016	2.500
	Clase AEC	25/07/2019	USD	0,016	2.219
	Clase AEC	23/08/2019	USD	0,016	2.185
	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,015	2.265
	Clase AUP	24/04/2019	USD	0,015	8.173
	Clase AUP	23/05/2019	USD	0,015	8.129
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,016	8.483
	Clase AUP	25/07/2019	USD	0,016	8.266
	Clase AUP	23/08/2019	USD	0,016	8.115
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,016	8.031
					63.444 USD
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Clase AEC	24/06/2019	USD	0,121	1.255.651
	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,140	1.388.353
	Clase AEP	24/06/2019	USD	0,138	215.616
	Clase AEP	24/09/2019	USD	0,165	301.759
	Clase ASC	24/06/2019	USD	0,090	457
	Clase ASC	24/09/2019	USD	0,105	1.206
	Clase ASP	24/06/2019	USD	0,089	471
	Clase ASP	24/09/2019	USD	0,106	560
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,122	115.178
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,145	153.216
	Clase DEC	24/06/2019	USD	0,118	772.504
	Clase DEC	24/09/2019	USD	0,134	818.166
	Clase DEP	24/06/2019	USD	0,132	76.647
	Clase DEP	24/09/2019	USD	0,157	94.883
	Clase DUP	24/06/2019	USD	0,113	253.033
	Clase DUP	24/09/2019	USD	0,134	297.835
	Clase ZEC	24/06/2019	USD	0,132	13
	Clase ZEC	24/09/2019	USD	0,153	15
	Clase ZUP	24/06/2019	USD	0,121	12
	Clase ZUP	24/09/2019	USD	0,144	14
					5.745.589 USD
Threadneedle (Lux) - Global Focus	Clase AEP	24/09/2019	USD	0,108	19.578
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,072	370
	Clase IUP	24/09/2019	USD	0,073	7
	Clase ZEP	24/09/2019	USD	0,109	217.622
					237.577 USD
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	Clase 1EP	24/06/2019	USD	0,164	309.832
	Clase 1EP	24/09/2019	USD	0,111	207.359
	Clase 1SC	24/06/2019	USD	0,108	78.283
	Clase 1SC	24/09/2019	USD	0,072	46.582
	Clase 1ST	24/04/2019	USD	0,041	18.671
	Clase 1ST	23/05/2019	USD	0,033	14.770
	Clase 1ST	24/06/2019	USD	0,031	13.470
	Clase 1ST	25/07/2019	USD	0,021	8.427
	Clase 1ST	23/08/2019	USD	0,029	11.761
	Clase 1ST	24/09/2019	USD	0,023	7.513

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa	Importe por Acción	Importe total
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (continuación)	Clase 1UP	24/06/2019	USD	0,148	109.664
	Clase 1UP	24/09/2019	USD	0,099	69.808
	Clase 1VT	24/04/2019	USD	0,038	1.165
	Clase 1VT	23/05/2019	USD	0,032	962
	Clase 1VT	24/06/2019	USD	0,033	348
	Clase 1VT	25/07/2019	USD	0,019	195
	Clase 1VT	23/08/2019	USD	0,027	279
	Clase 1VT	24/09/2019	USD	0,019	196
	Clase 2EP	24/06/2019	USD	0,163	3.843.204
	Clase 2EP	24/09/2019	USD	0,119	2.521.550
	Clase 2UP	24/06/2019	USD	0,142	749.673
	Clase 2UP	24/09/2019	USD	0,097	512.101
	Clase 3EP	24/06/2019	USD	0,162	2.316.951
	Clase 3EP	24/09/2019	USD	0,114	1.512.641
	Clase 3UP	24/06/2019	USD	0,142	5.107
	Clase 3UP	24/09/2019	USD	0,097	3.489
	Clase 8EP	24/06/2019	USD	0,162	27
	Clase 8EP	24/09/2019	USD	0,110	18
	Clase 8UP	24/06/2019	USD	0,146	10.893
	Clase 8UP	24/09/2019	USD	0,098	6.988
	Clase 9EP	24/06/2019	USD	0,162	16
	Clase 9EP	24/09/2019	USD	0,110	11
	Clase 9UP	24/06/2019	USD	0,141	14
	Clase 9UP	24/09/2019	USD	0,096	10
	Clase AEC	24/06/2019	USD	0,155	16
	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,103	10
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,140	14
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,095	10
	Clase DEC	24/06/2019	USD	0,154	15
	Clase DEC	24/09/2019	USD	0,103	10
	Clase DUP	24/06/2019	USD	0,140	14
	Clase DUP	24/09/2019	USD	0,095	10
					12.382.077 USD
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Clase XUP	24/09/2019	USD	0,251	2.429.481
					2.429.481 USD
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	Clase AEP	24/09/2019	USD	0,405	1.972
	Clase AFP	24/09/2019	USD	0,365	36
	Clase ASC	24/04/2019	USD	0,020	23.823
	Clase ASC	23/05/2019	USD	0,020	22.612
	Clase ASC	24/06/2019	USD	0,020	22.875
	Clase ASC	25/07/2019	USD	0,020	22.312
	Clase ASC	23/08/2019	USD	0,019	21.858
	Clase ASC	24/09/2019	USD	0,019	18.454
	Clase ASP	24/04/2019	USD	0,019	2
	Clase ASP	23/05/2019	USD	0,019	2
	Clase ASP	24/06/2019	USD	0,020	2
	Clase ASP	25/07/2019	USD	0,020	2
	Clase ASP	23/08/2019	USD	0,019	2
	Clase ASP	24/09/2019	USD	0,019	2

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa	Importe por Acción	Importe total
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income (continuación)	Clase AUP	24/04/2019	USD	0,028	2.839
	Clase AUP	23/05/2019	USD	0,028	2.840
	Clase AUP	24/06/2019	USD	0,028	2.840
	Clase AUP	25/07/2019	USD	0,028	4.171
	Clase AUP	23/08/2019	USD	0,028	3.664
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,027	3.348
	Clase AVC	24/04/2019	USD	0,019	3.121
	Clase AVC	23/05/2019	USD	0,019	3.079
	Clase AVC	24/06/2019	USD	0,019	3.107
	Clase AVC	25/07/2019	USD	0,019	2.829
	Clase AVC	23/08/2019	USD	0,018	2.705
	Clase AVC	24/09/2019	USD	0,018	1.758
	Clase IEP	24/09/2019	USD	0,410	41
	Clase IFP	24/09/2019	USD	0,370	37
	Clase IUP	24/09/2019	USD	0,367	37
	Clase ZEP	24/09/2019	USD	0,410	41
	Clase ZFP	24/09/2019	USD	0,375	38
	Clase ZUP	24/09/2019	USD	0,368	37
					170.486 USD
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Clase AEC	24/09/2019	USD	0,136	1
	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,130	1.267
					1.268 USD
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,119	11.852
	Clase IEC	24/09/2019	USD	0,125	22
					11.874 USD
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Clase 1EP	24/09/2019	EUR	0,034	455.988
	Clase 1GP	24/09/2019	EUR	0,033	365.664
	Clase 2EP	24/09/2019	EUR	0,321	1.509
	Clase 2GP	24/09/2019	EUR	0,364	36
	Clase 3EP	24/09/2019	EUR	0,051	3.654
	Clase 3GP	24/09/2019	EUR	0,053	67.983
	Clase 4GP	24/09/2019	EUR	0,044	137.438
	Clase 8EP	24/09/2019	EUR	0,034	106.794
	Clase 8GP	24/09/2019	EUR	0,034	14.315
	Clase 9EP	24/09/2019	EUR	0,321	32
	Clase 9GP	24/09/2019	EUR	0,365	37
	Clase AEP	24/09/2019	EUR	0,319	32
	Clase AUP	24/09/2019	EUR	0,290	29
	Clase DEP	24/09/2019	EUR	0,319	32
	Clase IEP	24/09/2019	EUR	0,321	896
	Clase ZEP	24/09/2019	EUR	0,321	32
					1.154.471 EUR
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Clase AUP	24/09/2019	USD	0,338	226
	Clase DUP	24/09/2019	USD	0,335	120
	Clase IEP	24/09/2019	USD	0,380	5.745

Notas a los estados financieros

(continuación)

7 DIVIDENDOS

(continuación)

Cartera	Clase de Acciones	Ex-fecha	Divisa	Importe por Acción	Importe total
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income (continuación)	Clase XUP	24/09/2019	USD	0,336	276.697
	Clase ZGP	24/09/2019	USD	0,392	39
	Clase ZUP	24/09/2019	USD	0,384	54.083
					336.910 USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Clase 9EP	24/09/2019	GBP	0,200	397.146
	Clase AGP	24/09/2019	GBP	0,507	243.990
	Clase IGP	24/09/2019	GBP	0,666	1.285.229
	Clase ZGP	24/09/2019	GBP	0,252	271.906
					2.198.271 GBP
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	Clase 9GP*	24/06/2019	GBP	0,107	11
	Clase AEC	24/06/2019	GBP	0,122	47
	Clase AEC	24/09/2019	GBP	0,077	54
	Clase ASC	24/06/2019	GBP	0,082	14
	Clase ASC	24/09/2019	GBP	0,051	9
	Clase AUC	24/06/2019	GBP	0,115	15
	Clase AUC	24/09/2019	GBP	0,072	9
	Clase DEC	24/06/2019	GBP	0,120	14
	Clase DEC	24/09/2019	GBP	0,075	9
	Clase DGP	24/06/2019	GBP	0,148	15
	Clase DGP	24/09/2019	GBP	0,088	9
	Clase IGP	24/06/2019	GBP	0,147	205.341
	Clase IGP	24/09/2019	GBP	0,089	97.918
	Clase LGP	24/06/2019	GBP	0,147	878.464
	Clase LGP	24/09/2019	GBP	0,083	563.277
	Clase ZGP	24/06/2019	GBP	0,136	654
	Clase ZGP	24/09/2019	GBP	0,093	448
					1.746.308 GBP
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Clase IEP	24/06/2019	EUR	0,060	6
	Clase IEP	24/09/2019	EUR	0,056	6
	Clase LEP	24/06/2019	EUR	0,062	15.911
	Clase LEP	24/09/2019	EUR	0,057	14.628
					30.551 EUR

* Consulte la nota 1.

Notas a los estados financieros

(continuación)

8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

La Sociedad Gestora recibirá una comisión de rendimiento según se establece a continuación con respecto a las Clases de Acciones de las Carteras que se enumeran en la tabla a continuación. Se establecerán provisiones diarias para el devengo de la comisión de rendimiento con respecto al saldo de la comisión de rendimiento (como se describe a continuación), por el cual el importe se pagará a la Sociedad Gestora al final de cada año natural (es decir, el 31 de diciembre). El importe de esta comisión de rendimiento depende del rendimiento del Valor liquidativo de la Clase de Acciones correspondiente dentro de la Cartera correspondiente en comparación con el rendimiento del índice de rendimiento correspondiente (el «Índice de rendimiento», según la tabla a continuación). Las acumulaciones solo se harán cuando el saldo de la comisión de rendimiento sea positivo y se supere la High Water Mark del VL (que se define a continuación).

Para evitar dudas, el rendimiento de las Clases de Acciones incluye los dividendos pagados.

Cartera	Clases de Acciones	Índice de rendimiento	Tasa de rendimiento
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Acciones A	LIBOR mayor a 3 meses (USD) ¹ o cero	20%
	Acciones D		
	Acciones I		
	Acciones Z		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Acciones J	Índice ICE BofAML Euro Currency Deposit Bid Rate Constant Maturity (1M) (Local Total Return) ² más elevado más 1,00%, o 1,00%	10%
	Acciones Y		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Acciones A	EURIBOR mayor a 3 meses (EUR) ² o cero	20%
	Acciones D		
	Acciones I		
	Acciones L		
	Acciones Z		
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	Acciones A	LIBOR ¹ mayor a 3 meses o cero	máx. 20%
	Acciones D		
	Acciones I		
	Acciones Z		
	Acciones 2		
	Acciones 9		
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Acciones A	Rendimiento del índice S&P 500 ³	máx. 20%
	Acciones D		
	Acciones I		
	Acciones Z		
	Acciones 2		
	Acciones 9		
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Acciones A	Rendimiento del índice MSCI All Countries World ⁴	máx. 20%
	Acciones D		
	Acciones I		
	Acciones Z		
	Acciones 2		

¹ El índice de referencia es proporcionado por ICE Benchmark Administration Limited, un administrador incluido en el registro de administradores de índices de referencia de la ESMA. La Sociedad Gestora mantiene un plan escrito en el que se establecen las medidas que se tomarán en caso de que el índice de referencia cambie sustancialmente o deje de cumplirse.

² La información actualizada sobre si el índice de referencia es proporcionado por un administrador incluido en el registro de administradores de índices de referencia de la ESMA estará disponible a más tardar el 1 de enero de 2020. La Sociedad Gestora mantiene un plan escrito en el que se establecen las medidas que se tomarán en caso de que el índice de referencia cambie sustancialmente o deje de cumplirse.

³ El índice de referencia es proporcionado por S&P Dow Jones, un administrador no incluido en el registro de administradores de índices de referencia de la ESMA. La Sociedad Gestora mantiene un plan escrito en el que se establecen las medidas que se tomarán en caso de que el índice de referencia cambie sustancialmente o deje de cumplirse.

⁴ El índice de referencia es proporcionado por MSCI Limited, un administrador incluido en el registro de administradores de índices de referencia de la ESMA. La Sociedad Gestora mantiene un plan escrito en el que se establecen las medidas que se tomarán en caso de que el índice de referencia cambie sustancialmente o deje de cumplirse.

El rendimiento de Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio, Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio, Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha Portfolio, Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha y Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha Portfolio, incluyendo el impacto de todas las comisiones aplicables, se compara con el Índice de rendimiento.

El saldo de la comisión de rendimiento se calculará sobre la diferencia entre el rendimiento del Índice de rendimiento y el rendimiento de la Clase de Acciones en cuestión (la «Diferencia diaria»):

- (i) en caso de que la Diferencia diaria sea positiva, el saldo de la comisión de rendimiento aumentará en una cantidad con respecto a la Diferencia diaria, a la tasa de rendimiento correspondiente; y

Notas a los estados financieros

(continuación)

8 COMISIONES DE RENDIMIENTO

(continuación)

(ii) si la Diferencia diaria es negativa, el saldo de la comisión de rendimiento se reducirá en una cantidad con respecto a la Diferencia diaria, a la tasa de rendimiento correspondiente.

Si el saldo de la comisión de rendimiento es positivo al final del año natural y se supera la High Water Mark del VL, la cantidad acumulada de la comisión de rendimiento se pagará a la Sociedad Gestora dentro del primer trimestre del año natural siguiente. Solo se pagará una comisión de rendimiento a la Sociedad Gestora si el Valor liquidativo de la Clase de Acciones pertinente supera la High Water Mark del VL.

Si al final del año natural, el saldo de la comisión de rendimiento es negativo y se ha excedido la High Water Mark del VL, se restablecerá dicha cantidad negativa. Para evitar dudas, no se cobraría ninguna comisión de rendimiento en este escenario.

Si al final del año natural el saldo de la comisión de rendimiento es negativo y no se ha superado la High Water Mark del VL, dicha cantidad negativa se transferirá y la Sociedad Gestora no recibirá el pago de una comisión de rendimiento hasta que el importe de la comisión de rendimiento acumulada sea positivo y se haya excedido la High Water Mark de VL, al final de cualquier año natural posterior.

En el caso de que una Cartera o una Clase de Acciones se liquide o una Cartera o Clase de Acciones quede inactiva, cualquier acumulación de comisiones de rendimiento pendiente se realizará y será pagadera a la Sociedad Gestora. A partir de entonces, cuando nuevos Accionistas hayan invertido en dicha Cartera o Clase de Acciones, se restablecerá el saldo de la comisión de rendimiento.

High Water Mark del VL: con respecto a cada Clase de Acciones, es el Valor liquidativo de una Acción de dicha Clase de Acciones en la última Fecha de valoración del último año natural pertinente en el que se pagó cualquier comisión de rendimiento acumulado, o se restableció el saldo negativo de la comisión de rendimiento. Si nunca se ha pagado una comisión de rendimiento, la High Water Mark del VL es el precio inicial de la Clase de Acciones correspondiente.

A 30 de septiembre de 2019, las comisiones de rendimiento ascendían a 2 USD para Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha, 6 EUR para Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities, 139.663 EUR para Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha, 9.723 GBP para Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha y 271.611 USD para Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha.

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

A 30 de septiembre de 2019, la SICAV tiene pendientes los siguientes contratos de divisas a plazo:

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	31/10/2019	USD	114.231	EUR	104.320	Operaciones comerciales	Barclays	213
	31/10/2019	USD	68.477.569	EUR	62.436.095	Operaciones comerciales	Barclays	236.689
	31/10/2019	USD	843.756	EUR	770.000	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	2.170
	31/10/2019	USD	3.199	EUR	2.920	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	8
	18/10/2019	USD	127.157	GBP	101.934	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.444
	18/10/2019	USD	23.829	GBP	19.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	300
	31/10/2019	USD	30.451.967	GBP	24.662.648	Operaciones comerciales	Barclays	18.676
	18/10/2019	EUR	985	USD	1.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	18/10/2019	SEK	18.739	USD	1.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	18/10/2019	EUR	428.323	USD	475.326	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.688)
	18/10/2019	EUR	341.908	USD	379.429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.137)
	18/10/2019	GBP	7.077.479	USD	8.829.154	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(100.734)
	18/10/2019	GBP	12.850.417	USD	16.030.894	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(182.900)
	18/10/2019	EUR	1.040	USD	1.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	GBP	1.055	USD	1.316	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (continuación)	18/10/2019	EUR	1.044	USD	1.159	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	GBP	71.058.501	USD	88.645.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.011.377)
	18/10/2019	EUR	9.913	USD	11.013	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(190)
	18/10/2019	EUR	8.737	USD	9.706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(167)
	18/10/2019	EUR	1.786	USD	1.968	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	18/10/2019	EUR	3.004	USD	3.309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	18/10/2019	GBP	7.275	USD	9.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(115)
	18/10/2019	EUR	1.460	USD	1.603	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	18/10/2019	EUR	6.467	USD	7.085	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	18/10/2019	GBP	128.378	USD	158.468	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(143)
	18/10/2019	EUR	248	USD	272	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	GBP	16.862	USD	20.891	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)
	31/10/2019	CAD	40.627	USD	30.676	Operaciones comerciales	Barclays	25
	18/10/2019	EUR	3.871	USD	4.243	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	18/10/2019	GBP	1.787	USD	2.201	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	GBP	186.506	USD	229.765	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	247
	18/10/2019	EUR	10	USD	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	70.511	USD	77.818	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(835)
	18/10/2019	GBP	501.641	USD	625.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.860)
	18/10/2019	SEK	198	USD	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	3.150	USD	3.927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	18/10/2019	EUR	4.475	USD	4.939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(53)
	18/10/2019	EUR	3.641	USD	4.019	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	18/10/2019	GBP	76.300	USD	95.141	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.043)
	18/10/2019	GBP	139.099	USD	173.449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.902)
	18/10/2019	EUR	11	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (continuación)	18/10/2019	GBP	11	USD	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	11	USD	12	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	769.948	USD	960.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.529)
	18/10/2019	EUR	7.271	USD	8.021	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(82)
	18/10/2019	GBP	3.760	USD	4.706	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(68)
	18/10/2019	GBP	18.352	USD	22.967	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(334)
	18/10/2019	GBP	19.571	USD	24.413	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(277)
	18/10/2019	GBP	397.407	USD	495.765	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.656)
	18/10/2019	GBP	25.086	USD	31.199	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(261)
	18/10/2019	EUR	3.169	USD	3.509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49)
	18/10/2019	EUR	2.516	USD	2.786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	18/10/2019	GBP	13.694	USD	17.117	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(228)
	18/10/2019	EUR	9.437	USD	10.458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(155)
	18/10/2019	GBP	13.914	USD	17.390	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(230)
	18/10/2019	EUR	3.672	USD	4.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(59)
	18/10/2019	GBP	5.459	USD	6.825	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(93)
	18/10/2019	GBP	12.072	USD	15.094	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(206)
	18/10/2019	EUR	1.912	USD	2.111	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	18/10/2019	EUR	9.440	USD	10.418	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(112)
	18/10/2019	SEK	193	USD	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	181.647	USD	201.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.260)
	18/10/2019	EUR	886.408	USD	983.681	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.910)
	18/10/2019	SEK	18.355	USD	1.911	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)
	18/10/2019	EUR	94.883	USD	105.296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.703)
	18/10/2019	EUR	984	USD	1.092	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	18/10/2019	EUR	6.656.714	USD	7.387.207	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(119.481)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (continuación)	18/10/2019	GBP	46.712.124	USD	58.273.373	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(664.855)
	31/10/2019	USD	79.110	AUD	116.907	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	168
	31/10/2019	USD	697	AUD	1.030	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	2
	31/10/2019	USD	14.714	CAD	19.502	Operaciones comerciales	Barclays	(23)
	31/10/2019	USD	1.434.279	CAD	1.899.298	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(959)
	18/10/2019	USD	5.864	EUR	5.279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	101
								(1.885.134) USD
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	21/10/2019	EUR	997.585	USD	1.092.270	Operaciones comerciales	JPMorgan	(2.608)
	21/10/2019	EUR	424.378	USD	470.000	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(6.010)
	21/10/2019	EUR	21.040	USD	23.125	Operaciones comerciales	Barclays	(136)
	21/10/2019	EUR	4.282.874	GBP	3.808.304	Operaciones comerciales	Barclays	(18.441)
	21/10/2019	EUR	3.587.131	USD	3.959.951	Operaciones comerciales	Barclays	(39.052)
								(66.247) EUR
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	21/10/2019	EUR	73.766.831	GBP	65.592.995	Operaciones comerciales	Barclays	(317.623)
	21/10/2019	EUR	20.128.753	USD	22.220.787	Operaciones comerciales	Barclays	(219.134)
	21/10/2019	EUR	195.829	GBP	173.735	Operaciones comerciales	Lloyds	(397)
	21/10/2019	EUR	59.133	USD	65.491	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(838)
	18/10/2019	EUR	50.429	CHF	55.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(633)
	21/10/2019	EUR	909.839	GBP	804.970	Operaciones comerciales	Lloyds	664
	18/10/2019	EUR	43.086	CHF	46.780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	18/10/2019	EUR	282	CHF	306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	4.116.513	EUR	3.709.446	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	60.983
	18/10/2019	CHF	88.170	EUR	80.619	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	500
	18/10/2019	CHF	134.481	EUR	122.964	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	762
	18/10/2019	CHF	682.909	EUR	624.426	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.871
	18/10/2019	CHF	201.459	EUR	184.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.142

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (continuación)								
	18/10/2019	CHF	126.663	EUR	115.816	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	718
	18/10/2019	CHF	71.491	EUR	65.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	405
								(469.532) EUR
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*								
	21/10/2019	EUR	905.104	USD	999.092	Operaciones comerciales	Barclays	(9.779)
	21/10/2019	EUR	964.788	GBP	855.890	Operaciones comerciales	Barclays	(1.901)
	21/10/2019	EUR	162.442	USD	179.900	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(2.296)
	21/10/2019	EUR	564.041	GBP	500.000	Operaciones comerciales	Barclays	(686)
	21/10/2019	EUR	4.431	USD	4.913	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(67)
	21/10/2019	EUR	792.536	GBP	700.000	Operaciones comerciales	Barclays	1.920
	21/10/2019	EUR	4.215.455	GBP	3.748.431	Operaciones comerciales	Barclays	(18.236)
	21/10/2019	EUR	4.714	USD	5.193	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(41)
	21/10/2019	EUR	218.549	USD	239.260	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(542)
	21/10/2019	EUR	704.064	GBP	623.930	Operaciones comerciales	Barclays	(636)
	21/10/2019	EUR	173.974	GBP	154.440	Operaciones comerciales	Barclays	(460)
	18/10/2019	GBP	3.557.206	EUR	4.015.145	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.018
	21/10/2019	GBP	9.381	EUR	10.575	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	20
	18/10/2019	GBP	3.430.390	EUR	3.871.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.941
	18/10/2019	GBP	1.009	EUR	1.133	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	18/10/2019	GBP	8.030.605	EUR	9.024.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	46.935
	18/10/2019	GBP	11.836.956	EUR	13.301.657	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69.181
	18/10/2019	GBP	2.311.686	EUR	2.609.963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.281
	18/10/2019	NOK	10.090	EUR	1.017	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	SEK	10.068	EUR	945	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	21/10/2019	USD	2.975	EUR	2.706	Operaciones comerciales	Barclays	17
	21/10/2019	USD	5.830	EUR	5.323	Operaciones comerciales	Barclays	15
								90.685 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	10/04/2019	GBP	29.000	EUR	32.121	Operaciones comerciales	HSBC	655
	10/04/2019	USD	20.000	EUR	17.690	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	651
	10/04/2019	GBP	110.680	EUR	121.732	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	3.359
	10/04/2019	GBP	29.943	EUR	32.842	Operaciones comerciales	HSBC	1.000
	10/04/2019	EUR	148.402	GBP	134.234	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(3.311)
	10/04/2019	EUR	20.665	GBP	18.630	Operaciones comerciales	HSBC	(390)
	10/04/2019	EUR	153.383	GBP	138.280	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(2.901)
	10/04/2019	EUR	16.214	USD	18.331	Operaciones comerciales	HSBC	(596)
	10/04/2019	EUR	15.846	USD	17.530	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(229)
	10/04/2019	EUR	122.547	GBP	112.411	Operaciones comerciales	HSBC	(4.501)
	10/04/2019	EUR	153.552	GBP	140.000	Operaciones comerciales	HSBC	(4.677)
	10/04/2019	EUR	182.966	USD	206.000	Operaciones comerciales	HSBC	(5.942)
	10/04/2019	EUR	542.522	GBP	499.375	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(21.876)
	10/04/2019	EUR	125.897	GBP	113.940	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(2.879)
	10/04/2019	EUR	401.637	GBP	359.334	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(4.484)
	18/10/2019	CHF	3.416	EUR	3.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	18/10/2019	CHF	3.418	EUR	3.125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	10/04/2019	USD	261.580	EUR	233.510	Operaciones comerciales	HSBC	6.364
	18/10/2019	SEK	9.946	EUR	933	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	10/04/2019	EUR	3.891.013	GBP	3.499.999	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(64.705)
	10/04/2019	EUR	2.386.671	USD	2.705.834	Operaciones comerciales	HSBC	(94.656)
	10/04/2019	EUR	108.297	GBP	97.960	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(2.418)
	10/04/2019	EUR	223.937	GBP	202.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(4.365)
	10/04/2019	EUR	91.512	USD	99.980	Operaciones comerciales	HSBC	(171)
								(206.039) EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	18/10/2019	EUR	21.065.890	GBP	18.670.803	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(24.365)
	18/10/2019	SEK	9.976	EUR	936	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	USD	1.071	EUR	965	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	18/10/2019	USD	1.079	EUR	972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	18/10/2019	GBP	458.762	EUR	517.270	Operaciones comerciales	UBS	940
	18/10/2019	EUR	109.235	AUD	175.664	Operaciones comerciales	Lloyds	643
	18/10/2019	GBP	398.282	USD	495.742	Operaciones comerciales	Lloyds	(4.178)
	18/10/2019	EUR	14.671.803	USD	16.221.233	Operaciones comerciales	Lloyds	(185.947)
	18/10/2019	EUR	1.271.659	USD	1.388.221	Operaciones comerciales	Lloyds	149
								(212.731) EUR
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	18/10/2019	EUR	2.485.972	USD	2.758.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44.621)
	18/10/2019	EUR	12.799.990	USD	14.204.634	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(229.748)
	18/10/2019	EUR	5.208.161	USD	5.779.693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(93.481)
	18/10/2019	EUR	151.382	USD	167.995	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.717)
	18/10/2019	EUR	480.497	USD	533.225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.624)
	18/10/2019	EUR	49	USD	54	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	164	USD	180	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	EUR	61	USD	67	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	1.582	USD	1.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30)
	18/10/2019	EUR	246	USD	272	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	18/10/2019	EUR	6.926	USD	7.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(73)
	18/10/2019	EUR	233	USD	258	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	18/10/2019	NOK	10.112	USD	1.131	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	18/10/2019	SEK	10.077	USD	1.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	18/10/2019	SGD	41.478	USD	30.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(215)
	18/10/2019	USD	28	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	370	EUR	336	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (continuación)								
	18/10/2019	USD	2.430	EUR	2.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	18/10/2019	USD	2.450	EUR	2.236	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	18/10/2019	USD	3.250	EUR	2.967	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	18/10/2019	USD	39.547	EUR	36.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	153
	18/10/2019	USD	399	EUR	364	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	USD	3.917	EUR	3.554	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	18/10/2019	USD	620	EUR	560	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	18/10/2019	USD	4.246	EUR	3.833	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	61
	18/10/2019	USD	0**	EUR	0**	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	3.500	EUR	3.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	18/10/2019	USD	11.017	EUR	10.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	96
	18/10/2019	EUR	65	USD	71	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	EUR	5.036.844	USD	5.589.576	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(90.406)
								(469.526) USD
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
	18/10/2019	EUR	455.674	USD	505.679	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.179)
	18/10/2019	EUR	388.907	USD	431.585	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.980)
	18/10/2019	EUR	667.686	USD	740.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.984)
	18/10/2019	EUR	983.616	USD	1.091.556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17.656)
	18/10/2019	EUR	29.850	USD	33.162	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(572)
	18/10/2019	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	5.000	USD	5.480	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(21)
	18/10/2019	EUR	196	USD	215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	NOK	9.967	USD	1.114	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	18/10/2019	SEK	9.935	USD	1.034	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	18/10/2019	SGD	180.196	USD	131.265	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(935)
	16/10/2019	USD	782.952	ZAR	11.955.001	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(3.755)
	10/09/2019	USD	560.479	EUR	507.490	Operaciones comerciales	JP Morgan	6.821
								(43.301) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
	18/10/2019	SGD	42	USD	30	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	729	USD	799	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	18/10/2019	SGD	32.729	USD	23.763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(91)
	18/10/2019	SGD	2.554	USD	1.854	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	18/10/2019	USD	2	SGD	2	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	565	SGD	775	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	18/10/2019	USD	18.245	EUR	16.646	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	70
	18/10/2019	USD	44.227	EUR	40.370	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	151
	18/10/2019	USD	180	EUR	165	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	23.340	EUR	21.268	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	119
	18/10/2019	USD	29.801	EUR	27.052	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	265
	18/10/2019	USD	2.178	EUR	1.974	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	18/10/2019	USD	22.429	EUR	20.247	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	323
	18/10/2019	USD	1.084	EUR	979	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	18/10/2019	USD	33.915	EUR	30.766	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	325
	18/10/2019	USD	3.888	EUR	3.527	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	18/10/2019	USD	5.184	EUR	4.666	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	89
	18/10/2019	USD	10.670	EUR	9.604	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	184
	16/10/2019	USD	1.134.315	ZAR	17.320.001	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(5.440)
	18/10/2019	SGD	554	USD	402	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	SGD	556	USD	404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	SGD	1.715	USD	1.249	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	18/10/2019	SGD	99	USD	72	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	SGD	385.247	USD	280.637	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.998)
	18/10/2019	SGD	946.449	USD	689.449	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.909)
	18/10/2019	SEK	9.854	USD	1.026	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(22)
	18/10/2019	NOK	9.886	USD	1.105	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	18/10/2019	EUR	13	USD	14	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (continuación)	18/10/2019	EUR	118.478	USD	130.516	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.163)
	18/10/2019	EUR	11.039.474	USD	12.250.925	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(198.148)
	18/10/2019	EUR	6.327.013	USD	7.021.327	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(113.564)
	18/10/2019	EUR	3.186.034	USD	3.535.663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(57.186)
	18/10/2019	EUR	3.352.954	USD	3.720.900	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60.182)
	18/10/2019	EUR	15.639.840	USD	17.356.126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(280.718)
								(721.854) USD
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	18/10/2019	EUR	791.618	USD	878.489	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.209)
	18/10/2019	EUR	773.255	USD	858.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13.879)
	18/10/2019	EUR	131.815.848	USD	146.281.056	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.365.964)
	18/10/2019	EUR	909.446	USD	1.009.247	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.324)
	18/10/2019	EUR	368.175	USD	408.578	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.608)
	18/10/2019	CHF	1.053	USD	1.068	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	18/10/2019	EUR	191.233	USD	212.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.432)
	18/10/2019	EUR	159.344	USD	176.830	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.860)
	18/10/2019	EUR	2.498	USD	2.751	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	18/10/2019	EUR	490	USD	538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	18/10/2019	EUR	4.996	USD	5.482	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	18/10/2019	EUR	0**	USD	0**	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	1.145	USD	1.429	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16)
	18/10/2019	SGD	15.000	USD	10.930	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(81)
	18/10/2019	SGD	504.459	USD	367.478	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.616)
	18/10/2019	SGD	1.150	USD	833	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	USD	1.599	SGD	2.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	18/10/2019	USD	9.491	EUR	8.567	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	137

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (continuación)								
	18/10/2019	USD	33.313	EUR	30.200	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	340
	18/10/2019	USD	2.266	EUR	2.057	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	18/10/2019	USD	16.065	EUR	14.658	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	62
								(2.425.491) USD
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
	18/10/2019	AUD	1.076	USD	740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	18/10/2019	EUR	24.713	USD	27.365	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(384)
	18/10/2019	EUR	400.996	USD	445.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.197)
	18/10/2019	EUR	187.348	USD	207.908	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.363)
	18/10/2019	EUR	3.035	USD	3.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54)
	18/10/2019	GBP	2.545	USD	3.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
	16/10/2019	KRW	3.000.000.000	USD	2.457.365	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	46.136
	16/10/2019	PHP	65.890.215	USD	1.259.605	Operaciones comerciales	UBS	11.680
	18/10/2019	SEK	10.099	USD	1.051	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	18/10/2019	SGD	3.282	USD	2.391	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	18/10/2019	SGD	3.000	USD	2.182	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(13)
	16/10/2019	SGD	2.000.000	USD	1.441.232	Operaciones comerciales	UBS	5.274
	18/10/2019	SGD	1.633.049	USD	1.189.610	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.470)
	18/10/2019	SGD	130.375	USD	94.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(676)
	18/10/2019	SGD	45.909	USD	33.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(152)
	18/10/2019	SGD	103.902	USD	75.222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(72)
	18/10/2019	SGD	190	USD	138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	16/10/2019	THB	55.000.000	USD	1.783.398	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	15.377
	16/10/2019	USD	660.920	IDR	9.600.000.000	Operaciones comerciales	Barclays	(15.212)
	16/10/2019	USD	3.060.255	PHP	161.000.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(46.079)
	18/10/2019	AUD	1.131	USD	778	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
								(3.310) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	11/08/2019	EUR	1.591.312	USD	1.794.792	Operaciones comerciales	Barclays	(50.116)
	11/08/2019	EUR	2.748.757	GBP	2.534.944	Operaciones comerciales	Barclays	(112.689)
	11/08/2019	JPY	30.604.800	EUR	256.885	Operaciones comerciales	Barclays	2.782
								(160.023) EUR
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	11/08/2019	JPY	574.422.202	USD	5.438.064	Operaciones comerciales	Lloyds	(108.495)
	18/10/2019	EUR	10.536.902	USD	11.693.202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(189.126)
	18/10/2019	EUR	2.284.380	USD	2.535.063	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41.002)
	18/10/2019	EUR	1.811.712	USD	2.010.525	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32.518)
	18/10/2019	EUR	1.003	USD	1.113	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	18/10/2019	EUR	58	USD	63	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	49.990	USD	55.398	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(820)
	18/10/2019	EUR	39.990	USD	44.299	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(639)
	18/10/2019	GBP	316.213	USD	394.476	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.501)
	18/10/2019	SEK	10.079	USD	1.049	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	18/10/2019	USD	13.262	EUR	11.937	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	228
	18/10/2019	USD	11.743	EUR	10.714	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
	18/10/2019	USD	253	EUR	230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	USD	29	EUR	26	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	28.746	EUR	25.940	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	425
	18/10/2019	USD	31.175	EUR	28.142	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	449
	18/10/2019	USD	7.721	EUR	7.010	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	67
	18/10/2019	USD	1.247	EUR	1.132	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	18/10/2019	USD	6.576	EUR	5.993	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	18/10/2019	USD	52.447	EUR	47.852	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	203
								(375.678) USD
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	18/10/2019	USD	143.395	EUR	129.396	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.119
	18/10/2019	USD	92.651	EUR	83.606	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.369
	18/10/2019	USD	16.991	EUR	15.503	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (continuación)	18/10/2019	USD	14.734	EUR	13.427	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75
	18/10/2019	USD	193.546	EUR	176.369	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	986
	18/10/2019	USD	58.728	EUR	53.607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	200
	18/10/2019	USD	37.258	EUR	34.009	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	127
	18/10/2019	USD	19.473	EUR	17.775	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66
	18/10/2019	USD	5.468	EUR	4.991	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	18/10/2019	USD	179.177	EUR	161.685	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.648
	18/10/2019	USD	5.547	EUR	5.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	82
	18/10/2019	USD	37.358	EUR	33.724	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	538
	21/10/2019	USD	47.356	GBP	37.792	Operaciones comerciales	HSBC	742
	18/10/2019	USD	102.080	EUR	92.543	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.041
	18/10/2019	USD	103.200	EUR	93.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.053
	18/10/2019	USD	26.879	EUR	24.368	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	274
	21/10/2019	USD	605.745	EUR	551.180	Operaciones comerciales	Lloyds	3.814
	18/10/2019	USD	32.157	EUR	29.196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	281
	18/10/2019	USD	7.594	EUR	6.895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	66
	18/10/2019	USD	89.889	EUR	81.612	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	785
	18/10/2019	USD	11.463	EUR	10.408	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	100
	18/10/2019	USD	4.744	EUR	4.307	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
	18/10/2019	USD	158.299	EUR	143.698	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.409
	18/10/2019	USD	34.182	EUR	31.029	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	304
	18/10/2019	USD	1.979.861	EUR	1.805.052	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.111
	18/10/2019	USD	1.182.232	EUR	1.077.849	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.441
	18/10/2019	USD	22	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	163.799	EUR	148.590	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.568
	18/10/2019	USD	76.405	EUR	69.624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	389
	21/10/2019	USD	89.077.418	EUR	80.700.453	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	945.742

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (continuación)	18/10/2019	USD	52.189	EUR	47.131	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	731
	18/10/2019	USD	99.690	EUR	90.028	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.396
	18/10/2019	USD	128.662	EUR	116.192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.802
	18/10/2019	USD	75.400	EUR	67.869	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.299
	18/10/2019	USD	27.688	EUR	24.923	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	477
	18/10/2019	USD	146.282	EUR	132.700	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.400
	18/10/2019	USD	91.480	EUR	82.986	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	875
	21/10/2019	USD	370.008	GBP	297.300	Operaciones comerciales	Barclays	3.304
	21/10/2019	USD	15.563.384	GBP	12.523.700	Operaciones comerciales	JP Morgan	116.108
	18/10/2019	USD	1.680	SGD	2.318	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	18/10/2019	EUR	84.288.623	USD	93.538.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.512.896)
	18/10/2019	EUR	50.300.092	USD	55.819.923	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(902.836)
	18/10/2019	EUR	926	USD	1.028	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	18/10/2019	EUR	6.437.143	USD	7.143.542	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(115.540)
	18/10/2019	SGD	111.160	USD	80.975	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(577)
	18/10/2019	SGD	200	USD	145	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	EUR	91.010	USD	100.390	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.026)
	18/10/2019	SGD	224	USD	163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	21/10/2019	EUR	415.000	USD	458.734	Operaciones comerciales	Barclays	(5.527)
	21/10/2019	GBP	58.000	USD	72.162	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(622)
	18/10/2019	EUR	12.988	USD	14.382	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(202)
	21/10/2019	EUR	121.900	USD	133.531	Operaciones comerciales	Lloyds	(409)
	21/10/2019	GBP	492.930	USD	607.139	Operaciones comerciales	Lloyds	858
	18/10/2019	EUR	26.931	USD	29.517	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(114)
	18/10/2019	EUR	66.214	USD	72.572	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(281)
	18/10/2019	SGD	932	USD	675	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	EUR	28.793.399	USD	31.953.130	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(516.813)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (continuación)								
	18/10/2019	SGD	23.764	USD	17.311	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(123)
	18/10/2019	EUR	6.174	USD	6.859	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(118)
	18/10/2019	EUR	13.688	USD	15.163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(219)
	18/10/2019	EUR	24.988	USD	27.681	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(399)
	18/10/2019	EUR	48.883	USD	54.150	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(781)
	21/10/2019	EUR	600.000	USD	665.113	Operaciones comerciales	Lloyds	(9.875)
	21/10/2019	EUR	348.712	USD	381.847	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(1.032)
	18/10/2019	EUR	39.450	USD	43.292	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(221)
	18/10/2019	EUR	167.984	USD	186.418	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.015)
	18/10/2019	CHF	1.010	USD	1.025	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
								(1.963.946) USD
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
	18/10/2019	EUR	50.149	USD	55.713	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(961)
	18/10/2019	EUR	679.890	USD	754.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.203)
	18/10/2019	EUR	4.444.314	USD	4.932.024	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(79.771)
	18/10/2019	EUR	16.561	USD	18.151	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(70)
	18/10/2019	EUR	37	USD	40	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	128.197	USD	140.682	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(718)
	18/10/2019	EUR	99.975	USD	110.114	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(963)
	18/10/2019	EUR	110.952	USD	122.204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.068)
	18/10/2019	EUR	2.131	USD	2.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	18/10/2019	EUR	29.975	USD	33.205	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(479)
	18/10/2019	EUR	260.427	USD	288.376	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.044)
	18/10/2019	EUR	198.690	USD	219.027	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.099)
	18/10/2019	EUR	65.954	USD	72.704	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(697)
	18/10/2019	EUR	16.899	USD	18.629	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(179)
	18/10/2019	EUR	31.253.038	USD	34.682.685	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(560.960)
	18/10/2019	USD	4.149	EUR	3.780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Focus (continuación)	18/10/2019	USD	9.641	EUR	8.752	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	86
	18/10/2019	USD	11.844	EUR	10.738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	121
	18/10/2019	USD	7.080	EUR	6.392	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	102
	18/10/2019	USD	9.559	EUR	8.626	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	141
	18/10/2019	USD	1.804	EUR	1.628	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
	18/10/2019	USD	1.079	EUR	974	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	18/10/2019	USD	1.065	EUR	958	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
								(663.705) USD
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	18/10/2019	EUR	928.885	USD	1.030.819	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(16.673)
	18/10/2019	EUR	11.388	USD	12.637	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(204)
	18/10/2019	USD	5	EUR	5	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	1.807	EUR	1.640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	18/10/2019	USD	20.689	EUR	18.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	189
	18/10/2019	USD	248	EUR	225	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	USD	0**	EUR	0**	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	25	EUR	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	82.057	USD	91.062	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.473)
	18/10/2019	EUR	250	USD	277	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
								(18.146) USD
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	18/10/2019	EUR	1.012	USD	1.123	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	18/10/2019	EUR	1.008	USD	1.119	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	18/10/2019	SGD	174	USD	126	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	SGD	45	USD	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	SGD	14.697	USD	10.678	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49)
	18/10/2019	SGD	37	USD	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	AUD	10	USD	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	AUD	106.009	USD	72.941	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.393)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (continuación)								
	18/10/2019	SGD	6.717.596	USD	4.893.496	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34.841)
	18/10/2019	SGD	3.331.362	USD	2.426.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17.278)
	18/10/2019	SGD	1.495.111	USD	1.089.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7.754)
	18/10/2019	USD	24	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	24	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	104.525	SGD	144.244	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	197
								(61.154) USD
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
	18/10/2019	CHF	1.157	EUR	1.058	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	18/10/2019	EUR	90	GBP	80	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	1	GBP	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	661	GBP	588	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	18/10/2019	GBP	411.376	EUR	462.279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.404
	18/10/2019	GBP	1.603	EUR	1.802	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	18/10/2019	GBP	5.000	EUR	5.614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34
	18/10/2019	GBP	2.915	EUR	3.289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	18/10/2019	GBP	2.878	EUR	3.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	GBP	1.717	EUR	1.934	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
								2.462 EUR
Threadneedle (Lux) - American								
	18/10/2019	EUR	14.008.667	USD	15.545.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(251.442)
	18/10/2019	EUR	145.476	USD	159.447	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(617)
	18/10/2019	EUR	3.125	USD	3.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12)
	18/10/2019	EUR	92.299	USD	101.677	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(906)
	18/10/2019	EUR	11.258	USD	12.399	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(108)
	18/10/2019	EUR	33.519	USD	36.721	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(126)
	18/10/2019	EUR	1.729	USD	1.898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	18/10/2019	EUR	855	USD	938	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American (continuación)	18/10/2019	EUR	62.656	USD	68.758	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(351)
	18/10/2019	EUR	801	USD	882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	18/10/2019	EUR	437	USD	481	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	18/10/2019	EUR	16.128	USD	17.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(155)
	18/10/2019	EUR	48.463	USD	53.458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(546)
	18/10/2019	EUR	6.661	USD	7.381	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(109)
	18/10/2019	EUR	148	USD	163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	EUR	5.828	USD	6.456	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(93)
	18/10/2019	EUR	23.775.312	USD	26.384.367	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(426.743)
	18/10/2019	EUR	2.585.726	USD	2.869.479	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46.411)
	18/10/2019	EUR	46.289.751	USD	51.369.495	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(830.854)
	18/10/2019	EUR	4.378	USD	4.826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(46)
	18/10/2019	EUR	4.600	USD	5.110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(88)
	18/10/2019	USD	1.137	EUR	1.038	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	18/10/2019	USD	91	EUR	83	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	11.740	EUR	10.711	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
	18/10/2019	USD	23.021	EUR	21.015	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	78
	18/10/2019	USD	2.445	EUR	2.232	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	18/10/2019	USD	144.497	EUR	131.902	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	487
	18/10/2019	USD	308.369	EUR	281.491	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.038
	18/10/2019	USD	523.511	EUR	477.881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.763
	18/10/2019	USD	57.863	EUR	52.820	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	195
	18/10/2019	USD	1.037.608	EUR	947.170	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3.494
	18/10/2019	USD	849	EUR	775	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
	18/10/2019	USD	24.736	EUR	22.541	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	126
	18/10/2019	USD	19.768	EUR	18.014	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	101
	18/10/2019	USD	3.043	EUR	2.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American (continuación)	18/10/2019	USD	2.109	EUR	1.915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	18/10/2019	USD	10.011	EUR	9.089	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	87
	18/10/2019	USD	6.282	EUR	5.703	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	55
	18/10/2019	USD	4.152	EUR	3.764	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
	18/10/2019	USD	10.673	EUR	9.676	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	109
	18/10/2019	USD	7.789	EUR	7.062	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	79
	18/10/2019	USD	854	EUR	771	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	18/10/2019	USD	9.129	EUR	8.238	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135
	18/10/2019	USD	15.593	EUR	14.082	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	218
	18/10/2019	USD	3.234	EUR	2.921	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
	18/10/2019	USD	5.712	EUR	5.158	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	80
	18/10/2019	USD	94.377	EUR	85.230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.322
	18/10/2019	USD	7.635	EUR	6.926	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	73
	18/10/2019	USD	409	EUR	371	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	18/10/2019	EUR	6.466.802	USD	7.176.455	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(116.073)
	18/10/2019	EUR	111.060	USD	123.247	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.993)
	18/10/2019	USD	8.828	EUR	7.947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	152
	18/10/2019	USD	11.420	EUR	10.309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	164
	18/10/2019	EUR	1.046.429	USD	1.161.262	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18.782)
	18/10/2019	EUR	19.776	USD	21.970	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(379)
	18/10/2019	EUR	92	USD	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
								(1.685.900) USD
Threadneedle (Lux) - American Select	18/10/2019	EUR	5.071.851	USD	5.628.428	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(91.034)
	18/10/2019	EUR	1.041	USD	1.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	USD	116.959	EUR	106.146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.068
	18/10/2019	USD	318.683	EUR	290.761	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.231
	18/10/2019	USD	24	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	18.497	EUR	16.787	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	169

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Select (continuación)								
	18/10/2019	USD	25	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	20.395	EUR	18.509	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	186
	18/10/2019	USD	32.191	EUR	29.384	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	110
	18/10/2019	USD	33	EUR	29	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	1.937	EUR	1.748	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	29
	18/10/2019	USD	22.489	EUR	20.410	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	205
	18/10/2019	USD	7.988	EUR	7.250	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	73
	18/10/2019	EUR	794.913	USD	882.146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14.268)
	18/10/2019	EUR	1.074	USD	1.192	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	EUR	883.436	USD	980.383	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15.857)
	18/10/2019	EUR	972	USD	1.071	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	18/10/2019	EUR	4.026	USD	4.458	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(63)
	18/10/2019	EUR	1.132	USD	1.247	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	18/10/2019	EUR	2.694	USD	2.956	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	18/10/2019	EUR	963.447	USD	1.069.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17.292)
	18/10/2019	EUR	339.089	USD	376.300	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.086)
								(141.603) USD
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies								
	18/10/2019	EUR	43.464	USD	48.233	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(780)
	18/10/2019	EUR	1.088	USD	1.208	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	18/10/2019	EUR	1.084	USD	1.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	EUR	1.099	USD	1.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	18/10/2019	USD	26	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	1.022	EUR	935	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	26	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	26	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(838) USD

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	18/10/2019	USD	147	SGD	202	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	121	EUR	110	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	598	SGD	823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	USD	11.842	SGD	16.306	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	49
	18/10/2019	SGD	665.907	USD	485.086	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.454)
	18/10/2019	SGD	8.319	USD	6.060	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	18/10/2019	EUR	4.457	USD	4.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(80)
	10/02/2019	SGD	1.101.659	USD	799.928	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(3.289)
	18/10/2019	SGD	14.840	USD	10.768	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(35)
								(6.848) USD
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	18/10/2019	USD	17.941	AUD	26.435	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	100
	18/10/2019	AUD	309	USD	210	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	SGD	8.352	USD	6.084	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	18/10/2019	AUD	1.386.149	USD	953.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18.220)
	18/10/2019	AUD	1.750.130	USD	1.204.204	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23.004)
	18/10/2019	EUR	4.480	USD	4.972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(80)
	18/10/2019	AUD	382	USD	259	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	SGD	385	USD	279	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	SGD	856.448	USD	623.888	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.442)
	18/10/2019	SGD	11.888.075	USD	8.659.979	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(61.656)
	18/10/2019	USD	65.554	SGD	90.342	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	213
	18/10/2019	USD	16.473	SGD	22.672	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75
	18/10/2019	USD	118	SGD	163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	188.969	SGD	259.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.237
	18/10/2019	USD	119	SGD	164	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	12.282	SGD	16.931	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
	18/10/2019	USD	167.367	SGD	230.723	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	492

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income (continuación)	18/10/2019	USD	277.427	SGD	381.363	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.598
	18/10/2019	USD	189.611	SGD	260.679	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.068
	18/10/2019	USD	13.992	SGD	19.203	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	103
	18/10/2019	USD	12.190	SGD	16.784	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	18/10/2019	USD	170.677	SGD	235.003	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	705
	18/10/2019	USD	70.130	SGD	96.592	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	267
	18/10/2019	USD	262.413	SGD	361.079	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.254
	18/10/2019	USD	87.319	SGD	120.304	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	306
	18/10/2019	USD	787	SGD	1.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	2.159	SGD	2.976	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	18/10/2019	USD	98	EUR	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	98	EUR	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	15.867	AUD	23.391	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	80
	18/10/2019	USD	5.165	AUD	7.615	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	18/10/2019	USD	141.716	AUD	206.958	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.034
	18/10/2019	USD	22.141	AUD	32.322	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	326
	18/10/2019	USD	801.628	AUD	1.167.937	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13.352
	18/10/2019	USD	52.396	AUD	76.292	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	904
	18/10/2019	USD	24.329	AUD	35.899	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	100
	18/10/2019	USD	173.336	AUD	253.136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.487
								(80.626) USD
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	18/10/2019	EUR	105	USD	117	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	CHF	2.675	USD	2.715	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	18/10/2019	EUR	16.164.069	USD	17.937.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(290.129)
	18/10/2019	EUR	370.103	USD	410.717	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.643)
	18/10/2019	EUR	4.127	USD	4.521	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	18/10/2019	EUR	20.165	USD	22.128	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(113)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities (continuación)								
	18/10/2019	EUR	6.553	USD	7.219	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(64)
	18/10/2019	EUR	19.891	USD	21.941	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(224)
	18/10/2019	EUR	2.818	USD	3.122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
	18/10/2019	EUR	40.857	USD	45.277	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(670)
	18/10/2019	EUR	7.188	USD	7.960	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(112)
	18/10/2019	EUR	10.692	USD	11.786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(113)
	18/10/2019	GBP	2.825	USD	3.525	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	18/10/2019	SGD	352.855.757	USD	257.041.112	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.830.071)
	18/10/2019	USD	26.052	EUR	23.740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	133
	18/10/2019	USD	3	EUR	2	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	19.247	EUR	17.325	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	332
	18/10/2019	USD	2.418	EUR	2.206	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
								(2.127.794) USD
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
	18/10/2019	CHF	1.894	USD	1.921	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	CHF	1.888	USD	1.916	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	EUR	2.056	USD	2.281	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
	18/10/2019	EUR	2.046	USD	2.271	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
	18/10/2019	EUR	2.069	USD	2.297	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
	18/10/2019	EUR	1.997	USD	2.216	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
	18/10/2019	EUR	2.066	USD	2.294	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(37)
	18/10/2019	USD	49	EUR	44	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(222) USD
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities								
	18/10/2019	EUR	2.447	SGD	3.731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24)
	18/10/2019	EUR	9.128	SGD	13.893	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(76)
	18/10/2019	EUR	1.323	SGD	2.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	18/10/2019	EUR	1.972	SGD	2.990	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	18/10/2019	EUR	16.269	SGD	24.620	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(41)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities (continuación)	18/10/2019	SGD	5.440.821	EUR	3.572.555	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	31.801
	18/10/2019	SGD	8.772	EUR	5.789	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	23
	18/10/2019	USD	2.715	EUR	2.447	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	40
	18/10/2019	USD	825.613	EUR	743.971	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12.231
								43.938 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	18/10/2019	USD	1.042	EUR	939	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	18/10/2019	SGD	22.801.865	EUR	14.972.180	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	133.275
	18/10/2019	SGD	2.609	EUR	1.720	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	18/10/2019	SGD	29.943	EUR	19.729	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	107
	18/10/2019	SGD	25.695	EUR	16.881	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	141
	18/10/2019	SGD	76.825	EUR	50.695	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	198
	18/10/2019	SGD	33.137	EUR	21.735	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	217
	18/10/2019	EUR	301.077	SGD	455.801	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(877)
	18/10/2019	EUR	3.095	SGD	4.693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	18/10/2019	EUR	30.192	SGD	46.078	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(334)
	18/10/2019	EUR	10.877	SGD	16.557	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(92)
	18/10/2019	EUR	124.697	SGD	188.583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(233)
	18/10/2019	EUR	9.402	SGD	14.227	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	18/10/2019	EUR	41.346	SGD	62.531	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78)
	18/10/2019	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	19	USD	21	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	1.030	EUR	928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	18/10/2019	EUR	18	CHF	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	CHF	983	EUR	899	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
								132.332 EUR

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	18/10/2019	USD	9.078.149	EUR	8.180.444	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	134.487
	18/10/2019	CHF	38.674	EUR	35.362	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	219
	18/10/2019	USD	1.313.903	EUR	1.183.976	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19.465
	18/10/2019	EUR	8.715	USD	9.564	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(45)
	18/10/2019	EUR	62.310	USD	68.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(214)
	18/10/2019	EUR	95.356	USD	105.936	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.676)
	18/10/2019	EUR	129.957	USD	144.016	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.955)
	18/10/2019	EUR	38.613	USD	42.773	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(566)
	18/10/2019	EUR	598.701	USD	656.682	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.776)
	18/10/2019	CHF	9.640	EUR	8.896	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(28)
	18/10/2019	CHF	2.024.669	EUR	1.851.282	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11.476
	18/10/2019	CHF	1.344.984	EUR	1.229.803	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7.624
	18/10/2019	EUR	40.527	CHF	44.022	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	25
	18/10/2019	EUR	26.601	CHF	28.895	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	18/10/2019	EUR	171.780	USD	188.416	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(797)
	18/10/2019	EUR	764	CHF	830	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	24.847	USD	27.253	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(115)
	18/10/2019	EUR	240.646	USD	264.083	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.236)
	18/10/2019	USD	3.263	EUR	2.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	18/10/2019	USD	31.516.379	EUR	28.399.839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	466.894
								630.810 EUR
Threadneedle (Lux) - European Select	18/10/2019	EUR	1.754	GBP	1.562	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11)
	18/10/2019	EUR	25.796	SGD	39.092	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(101)
	18/10/2019	EUR	162.620	SGD	248.190	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.799)
	18/10/2019	EUR	1.692	GBP	1.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	EUR	17	GBP	15	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	701	GBP	621	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Select (continuación)	18/10/2019	EUR	112.851	SGD	171.198	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(562)
	18/10/2019	EUR	98.727	SGD	149.693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(441)
	18/10/2019	EUR	5.005	GBP	4.433	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	EUR	2	USD	2	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	46.755	GBP	41.498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(120)
	18/10/2019	GBP	9.646	EUR	10.840	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	56
	18/10/2019	GBP	10.157.965	EUR	11.414.906	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	59.369
	18/10/2019	GBP	10.182	EUR	11.493	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	18/10/2019	SGD	28.888.071	EUR	18.968.507	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	168.848
	18/10/2019	SGD	26.418	EUR	17.328	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	173
	18/10/2019	SGD	5.017	EUR	3.296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	18/10/2019	SGD	8.771	EUR	5.762	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	48
	18/10/2019	SGD	20.832	EUR	13.726	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75
	18/10/2019	SGD	39.805	EUR	26.320	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	50
	18/10/2019	SGD	34.796	EUR	22.994	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	57
	18/10/2019	SGD	55.908	EUR	36.968	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
	18/10/2019	USD	663.432	EUR	597.828	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9.828
	18/10/2019	USD	1.122	EUR	1.011	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17
	18/10/2019	USD	3.444.601	EUR	3.103.977	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	51.029
	18/10/2019	USD	10.460	EUR	9.415	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	165
	18/10/2019	USD	13.501	EUR	12.247	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	119
	18/10/2019	USD	3.900	EUR	3.519	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
	18/10/2019	USD	6.950	EUR	6.274	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	92
	18/10/2019	USD	2.000	EUR	1.813	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	18/10/2019	USD	18.877	EUR	17.139	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	151
	18/10/2019	USD	7.800	EUR	7.081	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	64
	18/10/2019	USD	11.000	EUR	10.041	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	34

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - European Select (continuación)	18/10/2019	USD	26.070	EUR	23.786	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	92
	18/10/2019	GBP	100	EUR	113	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	1.737	EUR	1.959	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	3
								287.410 EUR
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	18/10/2019	CHF	491.466	EUR	449.378	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.786
	18/10/2019	CHF	1.921.412	EUR	1.756.868	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10.891
	18/10/2019	CHF	1.631	EUR	1.491	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	18/10/2019	CHF	4.163	EUR	3.793	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	18/10/2019	CHF	39.670	EUR	36.537	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(40)
	18/10/2019	EUR	10.960	CHF	11.906	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	18/10/2019	EUR	42.495	CHF	46.160	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	18/10/2019	EUR	36	CHF	39	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								13.716 EUR
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	18/10/2019	EUR	363.806	USD	403.730	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.531)
	18/10/2019	EUR	343.224	USD	380.888	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.161)
	18/10/2019	EUR	3.000	USD	3.325	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49)
	18/10/2019	GBP	135.133	USD	168.579	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.923)
	18/10/2019	USD	115	EUR	103	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	USD	40.467	EUR	36.425	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	697
	18/10/2019	USD	8.933	EUR	8.107	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	82
	18/10/2019	USD	7.530	EUR	6.834	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	69
	18/10/2019	USD	3.620	GBP	2.899	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	45
								(13.769) USD
Threadneedle (Lux) - Global Technology	18/10/2019	USD	79.117	EUR	72.218	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	270
	18/10/2019	USD	9.805	EUR	8.950	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	33
	18/10/2019	USD	3.365	EUR	3.070	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	18/10/2019	CHF	221.908	USD	225.168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.266)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Technology (continuación)	18/10/2019	EUR	9.903.193	USD	10.989.951	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(177.751)
	18/10/2019	EUR	1.076	USD	1.194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	EUR	139.099	USD	154.532	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.666)
	18/10/2019	EUR	95.854	USD	105.665	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.013)
	18/10/2019	EUR	111.760	USD	124.024	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.006)
	18/10/2019	EUR	6.248	USD	6.888	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(66)
	18/10/2019	EUR	41.131	USD	45.545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(639)
	18/10/2019	EUR	380.000	USD	417.008	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.128)
	18/10/2019	EUR	48.470	USD	53.125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(206)
	18/10/2019	EUR	873	USD	967	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(14)
	18/10/2019	EUR	37.547	USD	41.593	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(600)
	18/10/2019	EUR	25.139	USD	27.848	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(402)
	18/10/2019	EUR	55.209	USD	60.899	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(622)
	18/10/2019	EUR	19.164.683	USD	21.267.777	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(343.986)
	18/10/2019	USD	0**	EUR	0**	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	489.183	EUR	443.957	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4.469
	18/10/2019	USD	248.643	EUR	225.655	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.271
	18/10/2019	USD	27	EUR	24	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	5.104	CHF	5.027	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	54
	18/10/2019	USD	40.796	EUR	37.033	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	363
	18/10/2019	USD	23.168	EUR	21.112	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	118
	18/10/2019	USD	239	EUR	218	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	6.191	EUR	5.587	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	91
	18/10/2019	USD	2.165	EUR	1.954	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	32
	18/10/2019	USD	23.607	EUR	21.401	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	241
	18/10/2019	USD	189.048	EUR	171.641	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.650
	18/10/2019	USD	12	EUR	11	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Technology (continuación)	18/10/2019	USD	2.838	EUR	2.576	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
								(524.752) USD
Threadneedle (Lux) - UK Equities	18/10/2019	GBP	1.447	EUR	1.641	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	GBP	22.871	EUR	25.787	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	42
	18/10/2019	GBP	16.462	EUR	18.561	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	30
	18/10/2019	GBP	6.645	EUR	7.494	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	18/10/2019	GBP	488	EUR	551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	1.819	EUR	2.064	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	18/10/2019	GBP	4.763	EUR	5.374	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	18/10/2019	GBP	14.724	EUR	16.611	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	18/10/2019	GBP	47.003	EUR	52.996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	86
	18/10/2019	GBP	342.323	EUR	385.976	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	625
	18/10/2019	GBP	1.968	EUR	2.222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	GBP	23.828	EUR	26.902	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	18/10/2019	GBP	10.186	EUR	11.476	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	18/10/2019	GBP	7.680	EUR	8.653	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	18/10/2019	GBP	1.755	EUR	1.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	18/10/2019	CHF	507	GBP	414	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	EUR	1.278	GBP	1.137	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	18/10/2019	EUR	15.239	GBP	13.558	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
	18/10/2019	EUR	16.968.108	GBP	15.099.682	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(78.126)
	18/10/2019	CHF	7.794.282	GBP	6.342.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.302
	18/10/2019	USD	18.410.482	GBP	14.757.901	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	170.320
	18/10/2019	EUR	2.884	GBP	2.569	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(15)
	18/10/2019	EUR	3.170	GBP	2.823	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	18/10/2019	EUR	7.989	GBP	7.115	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	18/10/2019	CHF	1.017	GBP	827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equities (continuación)								
	18/10/2019	EUR	1.128.886	GBP	1.004.580	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.198)
	18/10/2019	EUR	1.349.787	GBP	1.201.157	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.215)
	18/10/2019	USD	87.950	GBP	70.501	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	814
	18/10/2019	EUR	813.982	GBP	724.351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.748)
	18/10/2019	CHF	35.048	GBP	28.518	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28
	18/10/2019	EUR	1.002	GBP	892	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	EUR	2.334.467	GBP	2.077.411	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10.749)
	18/10/2019	USD	11.401	GBP	9.167	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	77
	18/10/2019	EUR	1.046	GBP	927	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	EUR	11.226	GBP	9.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	18/10/2019	CHF	8.711	GBP	7.138	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(43)
	18/10/2019	GBP	37.416	USD	46.259	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(93)
	18/10/2019	GBP	325.131	USD	401.973	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(811)
	18/10/2019	GBP	12.049	USD	14.928	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56)
	18/10/2019	GBP	5.374	USD	6.633	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	GBP	4.225	USD	5.215	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	18/10/2019	GBP	3.506	USD	4.361	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	18/10/2019	GBP	438	USD	545	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	18/10/2019	GBP	3.325	USD	4.153	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	18/10/2019	GBP	182.110	USD	227.457	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.327)
	18/10/2019	GBP	15.733	USD	19.663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(211)
	18/10/2019	GBP	3.008	USD	3.761	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42)
	18/10/2019	GBP	143.831	CHF	176.168	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	344
	18/10/2019	GBP	19	CHF	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	6.073	CHF	7.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(54)
	18/10/2019	GBP	172	CHF	213	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equities (continuación)								
	18/10/2019	GBP	2.162	CHF	2.664	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	18/10/2019	GBP	29.466	CHF	36.530	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(287)
	18/10/2019	GBP	651	CHF	797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	GBP	27	CHF	33	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	106	EUR	120	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	1.738	EUR	1.963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	23.263	EUR	26.372	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(84)
	18/10/2019	EUR	2.230	GBP	1.974	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	CHF	7.521	GBP	6.122	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	18/10/2019	EUR	1.581	GBP	1.395	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	18/10/2019	EUR	391	GBP	345	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	CHF	1.737	GBP	1.410	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	18/10/2019	EUR	3.116	GBP	2.763	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	CHF	853	GBP	687	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	7
	18/10/2019	EUR	1.212	GBP	1.074	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	GBP	17	EUR	20	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	73.441	GBP	64.735	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	281
	18/10/2019	EUR	2.401	GBP	2.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	9
	18/10/2019	CHF	7.717	GBP	6.308	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(23)
	18/10/2019	CHF	1.458	GBP	1.186	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	2.111.511	GBP	1.692.594	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19.534
	18/10/2019	USD	4.539	GBP	3.627	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
	18/10/2019	GBP	4.152	USD	5.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(56)
	18/10/2019	GBP	1.216	USD	1.512	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(10)
	18/10/2019	GBP	9.159	USD	11.425	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(105)
	18/10/2019	GBP	896	USD	1.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9)
	18/10/2019	GBP	25.960	USD	32.488	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(383)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equities (continuación)								
	18/10/2019	GBP	27.980	USD	34.983	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(387)
	18/10/2019	EUR	2.570	GBP	2.281	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	18/10/2019	EUR	100	GBP	89	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								89.376 GBP
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
	18/10/2019	EUR	6.816	GBP	6.066	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(31)
	18/10/2019	EUR	694.294	GBP	617.843	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.197)
	18/10/2019	EUR	353	GBP	313	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	6.249	EUR	7.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	18/10/2019	GBP	10.560	EUR	11.920	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	18/10/2019	GBP	3.196	EUR	3.589	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	19
	18/10/2019	CHF	412.148	GBP	335.356	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	333
	18/10/2019	CHF	277.849	GBP	226.079	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	225
	18/10/2019	CHF	1.053	GBP	857	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	CHF	134.240	GBP	109.229	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	109
	18/10/2019	EUR	9.657	GBP	8.594	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(44)
	18/10/2019	EUR	1.349.740	GBP	1.201.115	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6.215)
	18/10/2019	EUR	1.218	GBP	1.084	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(6)
	18/10/2019	EUR	1.190	GBP	1.059	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	GBP	7	EUR	8	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	49.490	USD	61.549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(418)
	18/10/2019	GBP	22	USD	27	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	21	SGD	36	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	130	EUR	146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	21	EUR	23	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	10.685	EUR	12.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	27
	18/10/2019	SGD	1.740	GBP	1.016	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	4
	18/10/2019	USD	169.272	GBP	135.689	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.566

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (continuación)	18/10/2019	USD	1.118	GBP	896	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	18/10/2019	USD	706.413	GBP	566.263	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.535
	18/10/2019	USD	3.051.677	GBP	2.446.233	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	28.231
	18/10/2019	USD	11.607	GBP	9.286	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	125
	18/10/2019	USD	1.319	GBP	1.057	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	12
	18/10/2019	USD	1.085	GBP	869	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	18/10/2019	USD	1.949	GBP	1.562	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	18/10/2019	USD	1.943	GBP	1.562	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	18/10/2019	USD	7.327	GBP	5.860	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	81
	18/10/2019	USD	5.777	GBP	4.663	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	22
	18/10/2019	EUR	2.487.095	GBP	2.213.231	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(11.451)
	18/10/2019	EUR	1.082	GBP	963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	EUR	37.812	GBP	33.648	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(174)
								15.808 GBP
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	18/10/2019	USD	21.725	EUR	19.797	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	111
	18/10/2019	USD	54.364	EUR	49.624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	186
	18/10/2019	USD	22.260	EUR	20.309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	86
	18/10/2019	EUR	1.093.260	USD	1.213.232	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19.623)
	18/10/2019	CHF	84.385	USD	85.625	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(862)
	18/10/2019	GBP	45.805	USD	57.142	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(652)
	18/10/2019	EUR	291.718	USD	323.731	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.236)
	18/10/2019	EUR	2.134.532	USD	2.368.772	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(38.313)
	18/10/2019	GBP	2.172.900	USD	2.710.693	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(30.927)
	18/10/2019	GBP	135.509.466	USD	169.048.057	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.928.706)
	18/10/2019	GBP	203.210	USD	253.505	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.892)
	18/10/2019	EUR	979	USD	1.087	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(18)
	18/10/2019	EUR	500	USD	551	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha (continuación)	18/10/2019	EUR	2.986	USD	3.289	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	18/10/2019	USD	688	EUR	624	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
								(2.026.874) USD
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	21/10/2019	EUR	550.138	AUD	888.094	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	1.212
	21/10/2019	EUR	4.140.213	CAD	6.057.422	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(50.703)
	18/10/2019	GBP	23.092	EUR	26.065	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	21/10/2019	USD	1.152.176	EUR	1.040.684	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	14.360
	18/10/2019	GBP	15.797	EUR	17.922	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(77)
	18/10/2019	USD	8.046.647	EUR	7.250.943	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	119.205
	18/10/2019	GBP	974.668	EUR	1.095.273	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5.697
	18/10/2019	GBP	2.971.360	EUR	3.339.035	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	17.366
	18/10/2019	GBP	993	EUR	1.116	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	18/10/2019	GBP	388.084	EUR	436.105	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.268
	18/10/2019	GBP	119.318.920	EUR	134.083.378	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	697.366
	18/10/2019	GBP	2.476.580	EUR	2.783.031	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14.475
	18/10/2019	GBP	99.341	EUR	112.073	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	141
	21/10/2019	EUR	133.916.866	GBP	119.000.000	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(488.426)
	21/10/2019	EUR	135.757.067	GBP	120.619.787	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(477.690)
	21/10/2019	EUR	133.921.794	GBP	119.000.000	Operaciones comerciales	Barclays	(483.494)
	18/10/2019	EUR	20.863	GBP	18.500	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(34)
	18/10/2019	EUR	3.230	GBP	2.864	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	EUR	87	GBP	77	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	232.614	GBP	206.085	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(177)
	18/10/2019	EUR	55.466	GBP	49.127	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(27)
	18/10/2019	EUR	6.687	GBP	5.935	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(17)
	18/10/2019	EUR	19.039	GBP	16.898	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(49)
	18/10/2019	EUR	14.101	GBP	12.515	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities (continuación)	18/10/2019	EUR	74.803	GBP	66.549	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(370)
	18/10/2019	EUR	51.614	GBP	45.728	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	18/10/2019	EUR	5.965	GBP	5.258	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
	18/10/2019	EUR	30.137	GBP	26.565	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	130
	18/10/2019	EUR	35.949	GBP	31.827	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	EUR	11.000	GBP	9.739	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	EUR	563.995	GBP	497.459	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.076
	18/10/2019	EUR	34.791	GBP	30.984	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(209)
	18/10/2019	EUR	26.949	GBP	24.000	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(162)
	18/10/2019	EUR	11.198	GBP	9.972	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(67)
	18/10/2019	EUR	85.094	GBP	75.427	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(107)
	18/10/2019	EUR	251.683	GBP	223.091	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(317)
	21/10/2019	EUR	128.468.824	USD	141.854.427	Operaciones comerciales	Barclays	(1.429.326)
	21/10/2019	EUR	127.693.564	USD	140.999.999	Operaciones comerciales	Goldman Sachs	(1.422.176)
	21/10/2019	EUR	127.696.687	USD	141.000.000	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(1.419.048)
	21/10/2019	EUR	1.323.650	USD	1.467.164	Operaciones comerciales	Royal Bank of Scotland	(19.862)
	21/10/2019	EUR	1.170.724	USD	1.289.682	Operaciones comerciales	Barclays	(10.251)
								(4.928.324) EUR
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	21/10/2019	CAD	9.252	EUR	6.306	Operaciones comerciales	Barclays	95
	18/10/2019	CHF	1.884	EUR	1.723	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	11
	18/10/2019	CHF	202.328	EUR	185.001	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.147
	21/10/2019	EUR	78.704	GBP	69.630	Operaciones comerciales	Barclays	60
	21/10/2019	EUR	103.863	USD	114.415	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(908)
	21/10/2019	EUR	349.567	GBP	310.970	Operaciones comerciales	Barclays	(1.661)
	21/10/2019	EUR	1.675.665	USD	1.833.230	Operaciones comerciales	Barclays	(3.024)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities (continuación)	21/10/2019	EUR	553.177	CAD	809.336	Operaciones comerciales	Citigroup Global Markets	(6.775)
	21/10/2019	EUR	15.675.111	GBP	13.938.488	Operaciones comerciales	Barclays	(67.809)
	21/10/2019	EUR	17.776.429	USD	19.622.379	Operaciones comerciales	Barclays	(192.057)
	21/10/2019	EUR	112.715	GBP	100.000	Operaciones comerciales	JPMorgan	(230)
	21/10/2019	EUR	45.147	USD	50.000	Operaciones comerciales	Barclays	(639)
	21/10/2019	EUR	180.419	USD	200.000	Operaciones comerciales	Barclays	(2.725)
	18/10/2019	GBP	40.140.628	EUR	45.107.607	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	234.605
	18/10/2019	GBP	1.447	EUR	1.626	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	18/10/2019	GBP	1.444	EUR	1.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	21/10/2019	GBP	74.799	EUR	84.227	Operaciones comerciales	JP Morgan	255
	18/10/2019	GBP	1.449	EUR	1.629	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	18/10/2019	GBP	1.445	EUR	1.623	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	18/10/2019	NOK	10.016	EUR	1.010	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	SEK	9.983	EUR	937	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	USD	1.044	EUR	941	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	18/10/2019	USD	9.134.471	EUR	8.231.196	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	135.321
	18/10/2019	USD	1.050	EUR	946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	18/10/2019	USD	1.048	EUR	944	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
	18/10/2019	USD	1.051	EUR	947	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	16
								95.756 EUR
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	18/10/2019	CHF	1.133	EUR	1.036	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	18/10/2019	EUR	1.082	GBP	959	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	GBP	1.157.897	EUR	1.301.174	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.767
	18/10/2019	GBP	59.489.538	EUR	66.850.740	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	347.690
	18/10/2019	GBP	2.393	EUR	2.690	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	18/10/2019	GBP	23.624	EUR	26.782	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(96)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha (continuación)	18/10/2019	GBP	1.229.306	EUR	1.393.602	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.998)
	18/10/2019	GBP	2.311.686	EUR	2.609.963	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.281
	18/10/2019	GBP	1.161.485	EUR	1.305.548	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6.447
	18/10/2019	USD	2.429	EUR	2.189	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	36
								357.146 EUR
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	18/10/2019	GBP	14.574	EUR	16.382	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	72
	18/10/2019	GBP	6.255	EUR	7.023	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	37
	18/10/2019	GBP	95.064	EUR	107.248	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	120
	18/10/2019	GBP	8.330	EUR	9.403	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	6
	18/10/2019	CHF	1.031	GBP	839	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	CHF	99.106	GBP	80.640	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	80
	18/10/2019	EUR	2.740.678	GBP	2.438.890	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(12.619)
	18/10/2019	EUR	7	GBP	7	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	1.031	GBP	917	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	EUR	1.032	GBP	918	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	EUR	1.025	GBP	912	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	EUR	1.028	GBP	915	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	EUR	284	GBP	253	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	EUR	4.378.678	GBP	3.896.523	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20.160)
	18/10/2019	EUR	208.388	GBP	185.442	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(959)
	18/10/2019	GBP	1.006	EUR	1.135	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	GBP	1.631	EUR	1.841	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	GBP	14.357	EUR	16.288	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(62)
	18/10/2019	GBP	3.976	EUR	4.491	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	1	EUR	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	GBP	29.118	EUR	32.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	14
	18/10/2019	GBP	52.808	EUR	59.622	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	26
								(33.464) GBP

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	18/10/2019	EUR	2.859	USD	3.173	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(51)
	18/10/2019	EUR	1.076	USD	1.194	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(19)
	18/10/2019	USD	5.232	EUR	4.723	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	75
	18/10/2019	USD	74.684	EUR	67.780	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	682
	18/10/2019	USD	63	EUR	58	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	24	EUR	22	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	1	EUR	1	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	4.007	EUR	3.635	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
	18/10/2019	USD	4	EUR	4	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	3.382.714	USD	3.753.924	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(60.716)
								(59.990) USD
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	18/10/2019	EUR	136.989	USD	152.022	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.460)
	18/10/2019	EUR	1.136	USD	1.261	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(20)
	18/10/2019	EUR	25	USD	28	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	EUR	226.746	USD	249.741	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.183)
	18/10/2019	USD	150.464	EUR	135.882	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.107
	18/10/2019	USD	6.090	EUR	5.559	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21
	18/10/2019	USD	28	EUR	25	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
								(2.535) USD
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	18/10/2019	USD	3.983	EUR	3.631	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	18
	18/10/2019	USD	180	EUR	164	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1
	18/10/2019	USD	539	EUR	492	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	USD	42.378	EUR	38.146	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	730
	18/10/2019	USD	48.717	EUR	43.971	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	709
	18/10/2019	USD	36.547	EUR	32.987	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	532
	18/10/2019	USD	95.433	EUR	86.136	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.389
	18/10/2019	USD	14.281	GBP	11.425	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	190

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)	18/10/2019	USD	623	GBP	498	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	8
	18/10/2019	USD	81.801	GBP	65.424	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	1.115
	18/10/2019	USD	46.767	GBP	37.404	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	637
	18/10/2019	USD	0**	GBP	0**	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	1.486	GBP	1.195	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	18/10/2019	USD	44.174	GBP	35.367	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	556
	18/10/2019	USD	4.144	GBP	3.352	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	18/10/2019	USD	921.493	GBP	745.339	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2.289
	18/10/2019	USD	8.253	GBP	6.676	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	20
	18/10/2019	USD	227	GBP	184	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	91	GBP	74	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	0
	18/10/2019	USD	525	GBP	426	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	USD	440	GBP	353	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	5
	18/10/2019	USD	73.948	GBP	59.460	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	618
	18/10/2019	USD	7.928	GBP	6.343	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	106
	18/10/2019	USD	1.597.255	GBP	1.277.876	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	21.277
	18/10/2019	USD	8.280	SGD	11.384	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	47
	18/10/2019	USD	1.663	SGD	2.287	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	10
	18/10/2019	USD	3.645	SGD	5.007	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	24
	18/10/2019	SGD	3.422.095	USD	2.477.488	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.379)
	18/10/2019	EUR	9.129	USD	10.006	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(39)
	18/10/2019	SGD	779.260	USD	564.779	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.162)
	18/10/2019	EUR	2.392.081	USD	2.654.583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(42.935)
	18/10/2019	CHF	896.877	USD	910.054	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(9.160)
	18/10/2019	GBP	344.109	USD	429.276	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4.898)
	18/10/2019	EUR	1.831.960	USD	2.032.995	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(32.882)

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)	18/10/2019	EUR	4.687.490	USD	5.201.886	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(84.136)
	18/10/2019	CHF	218.732	USD	221.946	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2.234)
	18/10/2019	GBP	69.491.641	USD	86.690.822	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(989.074)
	18/10/2019	SGD	616.976	USD	449.442	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3.200)
	18/10/2019	GBP	620.727	USD	774.357	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8.835)
	18/10/2019	EUR	326.784	USD	362.645	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5.865)
	18/10/2019	CHF	31.586	USD	32.050	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(323)
	18/10/2019	EUR	6.996	USD	7.772	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(134)
	18/10/2019	EUR	78.278	USD	86.296	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(834)
	18/10/2019	CHF	29.260	USD	29.538	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(147)
	18/10/2019	GBP	11.240	USD	13.984	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(122)
	18/10/2019	EUR	58.610	USD	64.614	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(624)
	18/10/2019	EUR	154.042	USD	169.822	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.641)
	18/10/2019	CHF	7.155	USD	7.223	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(36)
	18/10/2019	USD	57.206	EUR	52.155	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	263
	18/10/2019	USD	22.189	EUR	20.230	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	102
	18/10/2019	USD	29.744	EUR	27.118	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	137
	18/10/2019	USD	4.267	EUR	3.873	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	38
	18/10/2019	USD	2.450	CHF	2.427	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	13
	18/10/2019	USD	10.262	CHF	10.163	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	53
	18/10/2019	USD	21.572	EUR	19.586	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	188
	18/10/2019	USD	9.520	EUR	8.594	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	137
	18/10/2019	USD	588	CHF	583	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	USD	6.644	EUR	5.996	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	97
	18/10/2019	USD	4.073	CHF	4.039	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	15
	18/10/2019	USD	16.738	CHF	16.600	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	63

Notas a los estados financieros

(continuación)

9 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN CONTRATOS DE DIVISAS A PLAZO

(continuación)

Cartera	Fecha de vencimiento	Divisa adquirida	Importe adquirido	Divisa vendida	Importe vendido	Motivo	Contraparte	Ganancia/(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (continuación)	18/10/2019	USD	354	CHF	351	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	2
	18/10/2019	SGD	20.084	USD	14.597	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(71)
	18/10/2019	SGD	798.350	USD	579.305	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1.880)
	18/10/2019	SGD	179.992	USD	130.778	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(594)
	18/10/2019	GBP	20.325	USD	25.286	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(220)
	18/10/2019	GBP	2.275.946	USD	2.831.524	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(24.676)
	18/10/2019	GBP	235	USD	295	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	18/10/2019	GBP	100	USD	125	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(2)
	18/10/2019	GBP	444	USD	556	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(7)
	18/10/2019	EUR	750	USD	826	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(8)
	18/10/2019	EUR	10.721	USD	11.819	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(114)
	18/10/2019	EUR	98	USD	108	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
	18/10/2019	EUR	3.004	USD	3.309	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(29)
	18/10/2019	EUR	1.568	USD	1.737	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(25)
	18/10/2019	EUR	200	USD	222	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(3)
	18/10/2019	EUR	245	USD	272	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	18/10/2019	CHF	731	USD	738	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(4)
	18/10/2019	CHF	1.033	USD	1.043	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(5)
	18/10/2019	CHF	309	USD	311	Operaciones de cobertura	JP Morgan Chase New York	(1)
								(1.186.893) USD

*Consulte la nota 1.

** Cantidad fraccionada redondeada a 0.

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 24	Compra	EUR	750.000	20/06/2021	(11.887)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Metro AG	Compra	EUR	100.000	20/06/2021	(1.181)	0,00
CDS	JPMorgan	RWE Finance II	Compra	EUR	260.000	20/06/2021	(4.623)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	55.000	20/06/2022	(2.624)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	55.000	20/06/2022	(2.624)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	60.000	20/06/2022	(2.862)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	80.000	20/06/2022	(3.816)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	580.000	20/12/2023	(29.753)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	200.000	20/12/2023	(10.260)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Innogy SE	Compra	EUR	50.000	20/06/2021	(889)	0,00
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Compra	EUR	4.200.000	20/12/2024	(593.545)	(0,27)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	1.650.000	20/12/2024	(65.751)	(0,03)
CDS	JPMorgan	BBVA SA	Compra	EUR	1.200.000	20/12/2024	(15.094)	(0,01)
CDS	JPMorgan	EDF	Compra	EUR	1.500.000	20/12/2024	(36.824)	(0,02)
CDS	Barclays	PostNL NV	Compra	EUR	50.000	20/12/2020	(586)	0,00
CDS	Barclays	Metro AG	Compra	EUR	75.000	20/06/2021	(886)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	74.000	20/06/2022	(4.253)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	150.000	20/06/2022	(8.622)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	295.000	20/06/2022	(16.956)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	185.000	20/06/2022	(10.633)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	146.000	20/06/2022	(8.392)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	10.050.000	20/12/2024	(115.838)	(0,05)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Compra	EUR	2.500.000	20/12/2024	(63.762)	(0,03)
CDS	Barclays	Veolia Environnnment	Compra	EUR	1.600.000	20/12/2024	(59.610)	(0,03)
CDS	Barclays	SSE Plc	Compra	EUR	1.400.000	20/12/2024	(22.791)	(0,01)
CDS	Barclays	Auchan	Compra	EUR	800.000	20/12/2024	34.865	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Compra	EUR	80.000	20/12/2020	(937)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Compra	EUR	225.000	20/09/2020	(2.201)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Metro AG	Compra	EUR	165.000	20/06/2021	(1.949)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Deutsche Bank AG	Compra	EUR	3.300.000	20/09/2024	416.055	0,19
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV	Compra	EUR	58.000	20/12/2020	(679)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Tesco plc	Compra	EUR	200.000	20/06/2021	(2.652)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	50.000	20/12/2023	(2.385)	0,00
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	4.050.000	20/12/2024	(46.681)	(0,02)
							(700.626) USD	(0,32)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Compra	EUR	17.000.000	20/12/2024	(397.707)	(0,30)
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Compra	EUR	4.200.000	20/12/2024	(544.437)	(0,40)
							(942.144) EUR	(0,70)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond* tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 31	Venta	EUR	1.000.000	20/06/2022	69.243	0,18
CDS	Goldman Sachs	Cellnex Telecom SA	Venta	EUR	300.000	20/06/2022	34.639	0,09
							103.882 EUR	0,27

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	61.000	20/06/2022	(3.216)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	120.000	20/06/2022	(6.327)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	245.000	20/06/2022	(12.917)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	150.000	20/06/2022	(7.908)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	124.000	20/06/2022	(6.538)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX Finsub 32	Compra	EUR	5.100.000	20/12/2024	104.680	0,08
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	7.730.000	20/12/2024	(81.725)	(0,06)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Compra	EUR	6.500.000	20/12/2024	(152.065)	(0,11)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Compra	EUR	7.000.000	20/12/2024	(163.762)	(0,12)
CDS	Barclays	Veolia Environnnment	Compra	EUR	1.250.000	20/12/2024	(42.717)	(0,03)
CDS	Barclays	SSE Plc	Compra	EUR	970.000	20/12/2024	(14.485)	(0,01)
CDS	Barclays	Auchan	Compra	EUR	580.000	20/12/2024	23.186	0,02
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(7.220)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(7.220)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	165.000	20/06/2022	(7.220)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	235.000	20/06/2022	(10.283)	(0,01)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	800.000	20/06/2023	(106.854)	(0,08)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	325.000	20/12/2023	(15.292)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Novafives SAS	Compra	EUR	500.000	20/12/2024	55.313	0,04
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Compra	EUR	11.400.000	20/12/2024	(1.477.757)	(1,11)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	1.330.000	20/12/2024	(48.614)	(0,04)
CDS	JPMorgan	BBVA SA	Compra	EUR	800.000	20/12/2024	(9.230)	(0,01)
CDS	JPMorgan	EDF	Compra	EUR	1.000.000	20/12/2024	(22.518)	(0,02)
CDS	Citigroup Global Markets	Deutsche Bank AG	Compra	EUR	2.200.000	20/12/2024	254.421	0,19
CDS	Citigroup Global Markets	Daimler AG	Compra	EUR	650.000	20/12/2024	(11.141)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	3.120.000	20/12/2024	(32.986)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	7.250.000	20/12/2024	(76.651)	(0,06)
							(1.887.046) EUR	(1,42)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado USD	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Venta	EUR	3.370.000	20/12/2024	476.249	0,84
							476.249 USD	0,84

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de Swaps de Rendimiento Total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones.	USD	8.977.314	22/03/2021	(40.631)	(0,02)
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 33 acciones y recibe US-1M-LIBOR.	USD	33.630.374	22/03/2021	121.081	0,07
							80.450 USD	0,05

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Compra	EUR	300.000	20/12/2020	(3.223)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Compra	EUR	100.000	20/12/2020	(1.074)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Compra	EUR	200.000	20/09/2020	(1.795)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Compra	EUR	300.000	20/09/2020	(2.692)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	ING Bank NV	Venta	EUR	300.000	20/06/2020	1.839	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Compra	EUR	1.000.000	20/09/2020	(8.973)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Compra	EUR	700.000	20/12/2020	(7.520)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	ING Bank NV	Venta	EUR	500.000	20/06/2020	3.064	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Compra	EUR	17.725.000	20/09/2020	(159.038)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Compra	EUR	5.150.000	20/12/2020	(55.323)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Metro AG	Compra	EUR	10.680.000	20/06/2021	(115.716)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	ING Bank NV	Venta	EUR	9.200.000	20/06/2020	56.386	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Iceland Bondco plc	Compra	EUR	9.000.000	20/12/2024	369.476	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Deutsche Bank AG	Compra	EUR	24.780.000	20/12/2024	2.865.710	0,17

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	12.220.000	20/12/2024	(113.833)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	Daimler AG	Compra	EUR	33.320.000	20/12/2024	(571.077)	(0,03)
CDS	Barclays	ITRAXX FINSR 25	Compra	EUR	900.000	20/06/2021	(13.084)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	400.000	20/06/2022	(21.089)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX FINSR 25	Compra	EUR	500.000	20/06/2021	(7.269)	0,00
CDS	Barclays	Innogy SE	Compra	EUR	700.000	20/03/2020	(3.208)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	100.000	20/06/2022	(5.272)	0,00
CDS	Barclays	Tesco plc	Compra	EUR	300.000	20/06/2020	(1.965)	0,00
CDS	Barclays	Tesco plc	Compra	EUR	600.000	20/06/2020	(3.930)	0,00
CDS	Barclays	Innogy SE	Compra	EUR	1.400.000	20/03/2020	(6.415)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX FINSR 25	Compra	EUR	2.900.000	20/06/2021	(42.161)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	1.000.000	20/06/2022	(52.723)	0,00
CDS	Barclays	RWE Finance II	Compra	EUR	25.300.000	20/03/2020	(115.930)	(0,01)
CDS	Barclays	PostNL NV	Compra	EUR	3.370.000	20/12/2020	(36.202)	0,00
CDS	Barclays	Metro AG	Compra	EUR	3.850.000	20/06/2021	(41.714)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX Europe SNR FIN	Compra	EUR	52.000.000	20/06/2021	(755.983)	(0,04)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	2.855.000	20/06/2022	(150.524)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	5.810.000	20/06/2022	(306.320)	(0,02)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	3.645.000	20/06/2022	(192.175)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	1.477.000	20/06/2022	(77.872)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Compra	EUR	2.853.000	20/06/2022	(150.418)	(0,01)
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	65.440.000	20/12/2024	(691.863)	(0,04)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Compra	EUR	15.000.000	20/12/2024	(350.918)	(0,02)
CDS	Barclays	NA IG 33	Compra	USD	150.000.000	20/12/2024	(2.703.683)	(0,16)
CDS	Barclays	Veolia Environnnment	Compra	EUR	17.000.000	20/12/2024	(580.958)	(0,03)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	300.000	20/03/2020	(1.309)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	500.000	20/06/2022	(21.879)	0,00
CDS	JPMorgan	Naturgy Energy Group	Compra	EUR	500.000	20/03/2020	(2.264)	0,00
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	600.000	20/12/2022	(73.154)	0,00
CDS	JPMorgan	Matalan Finance Plc	Compra	EUR	100.000	20/06/2023	9.913	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	900.000	20/06/2022	(39.383)	0,00
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	1.200.000	20/12/2022	(146.309)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Matalan Finance Plc	Compra	EUR	400.000	20/06/2023	39.651	0,00
CDS	JPMorgan	Naturgy Energy Group	Compra	EUR	1.100.000	20/03/2020	(4.981)	0,00
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	800.000	20/03/2020	(3.491)	0,00
CDS	JPMorgan	Gas Natural Capital	Compra	EUR	19.500.000	20/03/2020	(88.305)	(0,01)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	13.750.000	20/03/2020	(60.004)	0,00
CDS	JPMorgan	Metro AG	Compra	EUR	7.650.000	20/06/2021	(82.886)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(164.753)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(164.753)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	3.765.000	20/06/2022	(164.753)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	5.185.000	20/06/2022	(226.890)	(0,01)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Matalan Finance Plc	Compra	EUR	2.800.000	20/06/2023	277.554	0,02
CDS	JPMorgan	Matalan Finance Plc	Compra	EUR	3.200.000	20/06/2023	317.204	0,02
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Compra	USD	21.150.000	20/12/2022	(2.578.688)	(0,15)
CDS	JPMorgan	Selecta Group	Compra	EUR	9.000.000	20/06/2024	(1.129.902)	(0,07)
CDS	JPMorgan	ITRAXX FINSR 32	Compra	EUR	27.000.000	20/12/2024	(500.170)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Novafives SAS	Compra	EUR	9.600.000	20/12/2024	1.062.015	0,06
CDS	JPMorgan	TDC A/S	Compra	EUR	17.000.000	20/12/2024	436.814	0,03
CDS	JPMorgan	ITRAXX FINSR 32	Compra	EUR	68.500.000	20/12/2024	(8.879.502)	(0,53)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	18.560.000	20/12/2024	(678.409)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Lafargeholcim	Venta	EUR	8.750.000	20/12/2024	130.604	0,01
CDS	JPMorgan	Heidelbergcement	Compra	EUR	7.240.000	20/12/2024	(1.601.292)	(0,09)
CDS	JPMorgan	Westpac banking Corp.	Compra	USD	23.030.000	20/12/2024	(667.290)	(0,04)
CDS	JPMorgan	BHP Billiton	Compra	USD	12.080.000	20/12/2024	(328.309)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Banco bilbao Vizcaya Argentaria	Compra	EUR	9.700.000	20/12/2024	(111.918)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Crédit Agricole SA	Compra	EUR	8.550.000	20/12/2024	(23.802)	0,00
CDS	JPMorgan	BNP Paribas	Compra	EUR	8.590.000	20/12/2024	20.984	0,00
CDS	JPMorgan	EDF	Compra	EUR	10.050.000	20/12/2024	(226.308)	(0,01)
CDS	Credit Suisse	Rexel SA	Compra	EUR	7.000.000	20/12/2024	(1.391.513)	(0,08)
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Compra	EUR	200.000	20/06/2021	(3.155)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Pernod-Ricard SA	Compra	EUR	1.600.000	20/12/2019	(3.474)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Pernod-Ricard SA	Compra	EUR	800.000	20/12/2019	(1.737)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Compra	EUR	400.000	20/06/2021	(6.309)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Pernod-Ricard SA	Compra	EUR	29.500.000	20/12/2019	(64.056)	0,00
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV	Compra	EUR	3.595.000	20/12/2020	(38.619)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Compra	EUR	7.800.000	20/06/2021	(123.027)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Compra	EUR	7.500.000	20/12/2023	(1.160.959)	(0,07)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	26.360.000	20/12/2024	(278.690)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	BMW AG	Compra	EUR	14.480.000	20/12/2024	(320.232)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	13.660.000	20/12/2024	39.771	0,00
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	10.490.000	20/12/2024	391.423	0,02
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	9.830.000	20/12/2024	(40.134)	0,00
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Compra	EUR	4.115.000	20/12/2024	(88.348)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	BMW AG	Compra	EUR	8.300.000	20/12/2024	(183.558)	(0,01)
							(23.004.047) EUR	(1,36)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de swaps de incumplimiento crediticio:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(558)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(1.266)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(1.500)	0,00
CDS	JPMorgan	Pearson plc	Compra	EUR	40.000	20/06/2023	(906)	0,00
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(1.500)	0,00

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Compra/ Venta	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Valor de mercado EUR	% del patrimonio neto
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Compra	EUR	30.000	20/06/2023	(1.266)	0,00
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Compra	EUR	80.000	20/12/2023	(1.706)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	145.000	20/12/2023	(6.823)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Compra	EUR	260.000	20/12/2023	(1.416)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Compra	EUR	250.000	20/12/2023	(11.763)	(0,01)
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Compra	EUR	3.500.000	20/12/2024	(453.697)	(0,52)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Compra	EUR	850.000	20/12/2024	(31.069)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Naturgy Energy Group	Compra	EUR	800.000	20/12/2024	(20.548)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Lafargeholcim	Venta	EUR	800.000	20/12/2024	11.941	0,0100
CDS	JPMorgan	Heidelbergcement AG	Compra	EUR	800.000	20/12/2024	(176.938)	(0,20)
CDS	JPMorgan	Westpac banking Corp.	Compra	USD	1.700.000	20/12/2024	(49.257)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Banco bilbao Vizcaya Argentaria	Compra	EUR	650.000	20/12/2024	(7.500)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BHP Group Ltd.	Compra	USD	820.000	20/12/2024	(22.286)	(0,03)
CDS	JPMorgan	BNP Paribas SA	Compra	EUR	310.000	20/12/2024	757	0,00
CDS	JPMorgan	Crédit Agricole	Compra	EUR	750.000	20/12/2024	(2.088)	0,00
CDS	Barclays	Tesco plc	Compra	EUR	100.000	20/12/2023	(545)	0,00
CDS	Barclays	Credit Suisse group AG	Compra	EUR	400.000	20/06/2024	(4.058)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Finsub Series 32	Compra	EUR	2.700.000	20/12/2024	55.419	0,06
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	4.990.000	20/12/2024	(52.757)	(0,06)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Compra	EUR	6.800.000	20/12/2024	(159.083)	(0,18)
CDS	Barclays	Veolia Environment	Compra	EUR	830.000	20/12/2024	(28.364)	(0,03)
CDS	Barclays	SSE plc	Compra	EUR	960.000	20/12/2024	(14.335)	(0,02)
CDS	Barclays	Auchan	Compra	EUR	370.000	20/12/2024	14.791	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	60.000	20/06/2023	(558)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Compra	EUR	80.000	20/06/2023	(744)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Deutsche Bank AG	Compra	EUR	1.400.000	20/12/2024	161.905	0,18
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Compra	EUR	930.000	20/12/2024	(8.663)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	General Motors Company	Compra	USD	1.150.000	20/12/2024	(181.365)	(0,21)
CDS	Citigroup Global Markets	Daimler AG	Venta	EUR	1.710.000	20/12/2024	(29.308)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	EDF	Compra	EUR	750.000	20/12/2024	(16.889)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	2.010.000	20/12/2024	(21.251)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Compra	USD	4.750.000	20/12/2024	(50.219)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Compra	EUR	850.000	20/12/2024	(22.339)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	BMW AG	Compra	EUR	850.000	20/12/2024	(18.798)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings plc	Compra	EUR	940.000	20/12/2024	2.737	0,00
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings plc	Compra	EUR	735.000	20/12/2024	(15.780)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	750.000	20/12/2024	(3.062)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Compra	EUR	990.000	20/12/2024	36.941	0,04
CDS	Goldman Sachs	BMW AG	Compra	EUR	430.000	20/12/2024	(9.510)	(0,01)
							(1.145.224) EUR	(1,30)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de Swaps de Rendimiento Total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones y recibe 1M-TOIS -0,35%.	CHF	5.598.363	de 29/12/2027 a 28/09/2029	(79.024)	(0,08)
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 5 acciones y recibe DKDRA -0,35%.	DKK	55.214.130	de 18/08/2027 a 31/08/2029	67.331	0,06
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 26 acciones y recibe 1M-EONIA de -0,35% a -0,45%.	EUR	30.771.911	de 17/03/2027 a 03/10/2029	(390.210)	(0,38)
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 7 acciones y recibe 1M-SONIA -0,35%.	GBP	6.049.116	de 19/05/2027 a 24/09/2029	16.262	0,02
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe NKDRA -0,35%.	NOK	22.486.542	de 04/04/2029 a 15/08/2029	17.520	0,02
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones y recibe 1M-STIBOR -0,35%.	SEK	39.364.513	de 24/02/2027 a 19/07/2029	(49.310)	(0,05)
SRT	Goldman Sachs	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 5 acciones y recibe 1M-LIBOR de -0,80% a -0,35%.	USD	5.170.100	de 16/08/2028 a 01/10/2029	38.287	0,04
							(379.144) EUR	(0,37)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de Swaps de Rendimiento Total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 24 acciones y recibe 1M-LIBOR.	GBP	2.101.396	de 24/01/2022 a 03/06/2022	(33.518)	(0,34)
							(33.518) GBP	(0,34)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de Swaps de Rendimiento Total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga US-1M-LIBOR +0,30% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 16 acciones.	USD	22.801.395	27/07/2020	(96.214)	(0,09)
SRT	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 33 acciones y recibe US- 1M-LIBOR.	USD	21.397.420	27/07/2020	74.502	0,07
							(21.712) USD	(0,02)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de Swaps de Rendimiento Total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga el rendimiento de la acción subyacente y recibe AUD-1M-LIBOR.	AUD	2.965.110	24/01/2022	(33.294)	(0,02)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga DKDRA +0,30% y recibe el rendimiento de la acción subyacente.	DKK	2.209.121	24/01/2022	(2.635)	0,00
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M-EURIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones y recibe 1M-EONIA.	EUR	5.537.063	24/01/2022	(221.619)	(0,12)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga 1M-LIBOR y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 4 acciones y recibe 1M-LIBOR.	GBP	9.666.698	24/01/2022	(366.621)	(0,20)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga HIBOR +0,40% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 2 acciones.	HKD	19.594.680	24/01/2022	(100.690)	(0,06)
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga JPY-1M-LIBOR y recibe el rendimiento de la acción subyacente	JPY	261.201.920	24/01/2022	(55.465)	(0,03)

Notas a los estados financieros

(continuación)

10 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN SWAPS

(continuación)

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	UBS	Cesta de acciones	Paga US-1M-LIBOR +0,35% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 23 acciones. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 15 acciones y recibe US- 1M-LIBOR.	USD	83.977.052	24/01/2022	(926.135)	(0,52)
							(1.706.459) USD	(0,95)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities tenía pendientes los siguientes contratos de Swaps de Rendimiento Total:

Descripción	Contraparte	Subyacente/Emisor	Pagar/Recibir	Divisa	Importe nacional	Fecha de vencimiento	Ganancia no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
SRT	Citigroup	North America Commodities Basket	Paga 0,11% y recibe el rendimiento de BCOM BBG COMDTY index.	USD	32.810.525	30/09/2019	330.345	0,08
SRT	Credit Suisse	North America Commodities Basket	Paga de 0% a 0,25% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 3 índices. Paga el rendimiento de 2 índices subyacentes.	USD	115.463.987	30/09/2019	292.965	0,08
SRT	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Paga 0,11% y recibe el rendimiento de 2 índices subyacentes.	USD	106.802.758	30/09/2019	970.598	0,25
SRT	JPMorgan	North America Commodities Basket	Paga de 0% a 0,25% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 19 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 20 índices.	USD	1.420.093.770	30/09/2019	2.007.662	0,52
SRT	Macquarie	North America Commodities Basket	Paga de 0 a 0,17% y recibe el rendimiento de la cesta subyacente de 3 índices. Paga el rendimiento de la cesta subyacente de 3 índices.	USD	158.240.692	30/09/2019	1.513.161	0,39
							5.114.731 USD	1,32

*Consulte la nota 1.

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN FUTUROS

A 30 de septiembre de 2019, la contraparte de los contratos de futuros pendientes es UBS.

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bund Future	Ventas	(81)	EUR	(15.387.355)	06/12/2019	85.461	0,04
Euro-Bobl Future	Ventas	(187)	EUR	(27.654.614)	06/12/2019	119.006	0,05
Euro-Buxl Future	Ventas	(2)	EUR	(474.237)	06/12/2019	5.138	0,00
10-Year Australian Treasury Bond Future	Compras	4	AUD	397.519	16/12/2019	4.076	0,00
10 Year Government of Canada Bond Future (MSE)	Compras	35	CAD	3.769.637	18/12/2019	(31.986)	(0,01)
10-Year US Treasury Note Future	Compras	16	USD	2.085.000	19/12/2019	5.719	0,00
US Ultra Bond	Ventas	(7)	USD	(1.343.344)	19/12/2019	(1.750)	0,00
20-Year US Long Bond	Ventas	(8)	USD	(1.298.500)	19/12/2019	(945)	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Compras	2	USD	284.813	19/12/2019	(750)	0,00
Long Gilt Future	Ventas	(100)	GBP	(16.542.395)	27/12/2019	(158.720)	(0,07)
5-Year US Treasury Note Future	Compras	56	USD	6.672.313	31/12/2019	(7.875)	0,00
2-Year US Treasury Note Future	Compras	78	USD	16.809.000	31/12/2019	(12.188)	(0,01)
						5.186 USD	0,00

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bund Future	Ventas	(18)	EUR	(3.136.500)	06/12/2019	(2.400)	0,00
Euro-Bobl Future	Ventas	(79)	EUR	(10.716.350)	06/12/2019	35.811	0,02
Euro-OAT Future	Ventas	(15)	EUR	(2.554.650)	06/12/2019	12.900	0,01
Euro-Buxl Future	Ventas	(1)	EUR	(217.500)	06/12/2019	2.357	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(5)	USD	(597.654)	19/12/2019	(5.733)	0,00
20-Year US Long Bond	Ventas	(3)	USD	(446.650)	19/12/2019	709	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Ventas	(7)	USD	(914.368)	19/12/2019	1.480	0,00
Long Gilt Future	Ventas	(11)	GBP	(1.669.110)	27/12/2019	(15.791)	(0,01)
5-Year US Treasury Note Future	Ventas	(21)	USD	(2.295.099)	31/12/2019	2.558	0,00
						31.891 EUR	0,02

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN FUTUROS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond tenía pendiente el siguiente contrato de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Long Gilt Future	Ventas	(50)	GBP	(7.586.862)	27/12/2019	5.652	0,00
						5.652 EUR	0,00

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - European Social Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bobl Future	Ventas	(46)	EUR	(6.239.900)	06/12/2019	15.820	0,02
Mid-Term Euro-BTP Future	Ventas	(3)	EUR	(437.520)	06/12/2019	(750)	0,00
Short-Term Euro-BTP Future	Ventas	(6)	EUR	(676.140)	06/12/2019	(480)	0,00
Long Gilt Future	Ventas	(26)	GBP	(3.945.168)	27/12/2019	(36.781)	(0,05)
						(22.191) EUR	(0,03)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond tenía pendientes los siguientes contratos de futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bund Future	Ventas	(131)	EUR	(22.826.750)	06/12/2019	116.980	0,09
Euro-Bobl Future	Ventas	(283)	EUR	(38.388.950)	06/12/2019	157.510	0,12
Euro-OAT Future	Ventas	(16)	EUR	(2.724.960)	06/12/2019	14.880	0,01
Euro-Buxl Future	Ventas	(5)	EUR	(1.087.500)	06/12/2019	10.750	0,01
Euro-Schatz Future	Ventas	(24)	EUR	(2.695.920)	06/12/2019	5.880	0,00
Mid-Term Euro-BTP Future	Ventas	(17)	EUR	(2.479.280)	06/12/2019	(7.310)	(0,01)
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(3)	USD	(358.592)	19/12/2019	(3.440)	0,00
US Ultra Bond	Compras	12	USD	2.112.342	19/12/2019	3.010	0,00
20-Year US Long Bond	Compras	9	USD	1.339.949	19/12/2019	(1.935)	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Ventas	(4)	USD	(522.496)	19/12/2019	745	0,00
Long Gilt Future	Ventas	(101)	GBP	(15.325.462)	27/12/2019	(144.989)	(0,11)
5-Year US Treasury Note Future	Compras	48	USD	5.245.941	31/12/2019	(6.192)	0,00
						145.889 EUR	0,11

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN FUTUROS

(continuación)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds tenía pendientes los siguientes contratos de Futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(65)	USD	(8.470.313)	19/12/2019	19.297	0,01
5-Year US Treasury Note Future	Compras	185	USD	22.042.462	31/12/2019	(24.570)	(0,01)
						(5.273) USD	0,00

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de Futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
E-mini S&P 500 Future (CME)	Compras	5	USD	683.017	20/12/2019	(5.247)	(0,02)
						(5.247) EUR	(0,02)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return tenía pendientes los siguientes contratos de Futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Topix Index Future	Compras	36	JPY	5.289.658	12/12/2019	171.547	0,30
E-mini S&P 500 Future (CME)	Ventas	(91)	USD	(13.552.175)	20/12/2019	105.105	0,19
						276.652 USD	0,49

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tenía pendientes los siguientes contratos de Futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
E-mini S&P 500 Future (CME)	Ventas	(208)	USD	(30.976.401)	20/12/2019	(447.725)	(0,24)
						(447.725) USD	(0,24)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de Futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bund Future	Ventas	(752)	EUR	(131.036.000)	06/12/2019	747.440	0,04
Euro-Bobl Future	Ventas	(1.266)	EUR	(171.732.900)	06/12/2019	722.930	0,04
Euro-Buxl Future	Ventas	(42)	EUR	(9.135.000)	06/12/2019	92.561	0,01

Notas a los estados financieros

(continuación)

11 GANANCIA/(PÉRDIDA) NETA NO REALIZADA EN FUTUROS

(continuación)

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(971)	USD	(116.064.426)	19/12/2019	263.885	0,02
20-Year US Long Bond	Ventas	(221)	USD	(32.903.194)	19/12/2019	52.263	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Ventas	(516)	USD	(67.401.968)	19/12/2019	151.177	0,01
Long Gilt Future	Ventas	(1.283)	GBP	(194.678.885)	27/12/2019	(1.826.974)	(0,11)
5-Year US Treasury Note Future	Ventas	(284)	USD	(31.038.485)	31/12/2019	34.598	0,00
						237.880 EUR	0,01

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities tenía pendientes los siguientes contratos de Futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	Ganancia/ (Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Euro-Bund Future	Ventas	(85)	EUR	(14.811.251)	06/12/2019	50.270	0,06
Euro-Bobl Future	Ventas	(105)	EUR	(14.243.250)	06/12/2019	58.950	0,06
Euro-OAT Future	Ventas	(13)	EUR	(2.214.030)	06/12/2019	11.180	0,01
Euro-Buxl Future	Ventas	(2)	EUR	(435.000)	06/12/2019	4.713	0,01
Euro-Schatz Future	Ventas	(2)	EUR	(224.660)	06/12/2019	530	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Ventas	(55)	USD	(6.574.195)	19/12/2019	14.734	0,02
20-Year US Long Bond	Ventas	(2)	USD	(297.766)	19/12/2019	473	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Ventas	(24)	USD	(3.134.975)	19/12/2019	7.450	0,01
Long Gilt Future	Ventas	(69)	GBP	(10.469.870)	27/12/2019	(99.867)	(0,12)
5-Year US Treasury Note Future	Ventas	(41)	USD	(4.480.908)	31/12/2019	4.995	0,01
						53.428 EUR	0,06

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha Fund tenía pendiente el siguiente contrato de Futuros:

Descripción	Estado	Número de contratos	Divisa	Compromisos nacionales en la divisa base de la cartera	Fecha de vencimiento	(Pérdida) no realizada en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
FTSE 100 Index Future (LIF)	Ventas	(13)	GBP	(959.856)	20/12/2019	(10.530)	(0,11)
						(10.530) GBP	(0,11)

Notas a los estados financieros

(continuación)

12 OPCIONES AL VALOR DE MERCADO

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income tenía pendientes las siguientes Opciones:

Descripción	Contraparte	Precio de ejercicio	Divisa	contratos	Fecha de vencimiento	Compromiso en la divisa base de la cartera	Valor de mercado en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Opciones sobre Futuros								
Call S&P 500 Index	UBS	3.065	USD	(128)	18/10/2019	39.232.000*	(42.240)	(0,02)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS	3.600	EUR	(368)	18/10/2019	14.442.970*	(93.077)	(0,03)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.475	GBP	(126)	18/10/2019	11.606.418*	(69.871)	(0,03)
							(205.188) USD	(0,08)

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha tenía pendientes las siguientes Opciones:

Descripción	Contraparte	Precio de ejercicio	Divisa	contratos	Fecha de vencimiento	Compromiso en la divisa base de la cartera	Valor de mercado en la divisa base de la cartera	% del patrimonio neto
Opciones sobre Futuros								
Put NASDAQ 100 Stock Index	UBS	7.500	USD	6	17/12/2020	4.500.000	342.000	0,18
Put NASDAQ 100 Stock Index	UBS	7.500	USD	15	18/06/2020	11.250.000	622.500	0,34
							964.500 USD	0,52

*El compromiso en posiciones cortas de compra es ilimitado.

13 AGRUPACIÓN

La SICAV podrá invertir y administrar la totalidad o parte de los activos establecidos para dos o más Carteras («Carteras Participantes») de forma conjunta. Cualquier grupo de activos de este tipo se formará mediante la transferencia de efectivo u otros activos (sujeto a que dichos activos sean apropiados con respecto a la política de inversión del conjunto en cuestión) de cada una de las Carteras Participantes.

La participación de una Cartera Participante en un conjunto de activos se medirá por referencia a participaciones nocionales de igual valor en el conjunto de activos.

A 30 de septiembre de 2019, la SICAV no tenía un conjunto de activos. Sin embargo, la cartera Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return para fines de gestión de inversiones se divide por clases de activos en diversas cestas que solo posee.

14 CAMBIOS EN LA COMPOSICIÓN DE ESTADOS DE LA CARTERA

Los cambios en los Estados de cuenta de la Cartera están disponibles para los Accionistas previa solicitud y de forma gratuita en el domicilio social de la SICAV.

15 AJUSTE DE DILUCIÓN

Una Cartera podrá sufrir una dilución del Valor liquidativo por Acción debido a que los inversores compran o venden Acciones en una Cartera a un precio que no refleja las operaciones y otros costes que surgen cuando el Gestor de Inversiones realiza operaciones de valores para dar cabida a las entradas de efectivo o salidas. Para contrarrestar este impacto, se podrá adoptar un Ajuste de Dilución (según se define en el Folleto) para proteger los intereses de los Accionistas de la SICAV. Si en un Día de Valoración, las transacciones netas agregadas en Acciones de una Cartera superan un umbral predeterminado, según lo determinado y revisado para cada Cartera de forma periódica por la Sociedad Gestora, el Valor liquidativo por Acción se podrá ajustar hacia arriba o hacia abajo para reflejar las entradas netas y salidas netas respectivamente.

Se podrá aplicar un Ajuste de Dilución en todas las Carteras con la excepción de Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities. El alcance del ajuste del precio será establecido por la Sociedad Gestora para reflejar los costes de negociación y otros costes. Dicho ajuste podrá variar de Cartera a Cartera y no superará el 2% del Valor liquidativo original por Acción, excepto Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity, para el cual no superará el 5% del Valor liquidativo original por Acción. El Valor liquidativo oficial por Acción al final del periodo, divulgado en la sección de Información Estadística de este informe, por lo tanto, podrá incluir un Ajuste de Dilución, que no se reconocerá en el Estado en el patrimonio neto y en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto.

Las estimaciones de la cantidad de Ajuste de Dilución, así como el número de veces que se ha aplicado el Ajuste de Dilución durante el periodo, se publican en el sitio web www.columbiathreadneedle.com.

Al cierre del periodo, no se había aplicado ningún Ajuste de Dilución.

Notas a los estados financieros

(continuación)

16 COSTES DE TRANSACCIÓN

Para el periodo del informe, la SICAV incurrió en costes de transacción relacionados con la compra o venta de valores mobiliarios o instrumentos del mercado monetario de la siguiente manera:

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond ^{1,2}	USD	n/a
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond ¹	USD	n/a
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond ¹	EUR	n/a
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	3.946
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond ^{1,2}	EUR	n/a
Threadneedle (Lux) - European Social Bond ¹	EUR	n/a
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond ¹	EUR	n/a
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds ¹	USD	n/a
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt ¹	USD	n/a
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds ¹	USD	n/a
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond ¹	USD	n/a
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond ¹	USD	n/a
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return ¹	EUR	n/a
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	7.063
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	71.914
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	367.561
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	84.406
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	499.008
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	159.547
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	256.289
Threadneedle (Lux) - American	USD	54.293
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	32.004
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	111.134
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	211.304
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	112.251
Threadneedle (Lux) - Asian Focus ²	USD	8.694
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	USD	13.023
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	114.549
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	1.504
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	EUR	205.951
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	95.695
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	203.442
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	308.093
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	571.077
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	294.243
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	44.388
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	76.211
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	363.907
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	168.684
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	USD	14.449
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	13.614
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities ¹	EUR	n/a
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities ¹	EUR	1
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	440.708
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	GBP	13.354
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	12.662
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	64.469
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities ¹	USD	n/a
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	USD	1.640

Los costes de transacción se incluyen en el coste total de inversión revelado en los Estados de cuentas de la Cartera. El importe de los costes de transacción soportados por la SICAV durante el periodo del informe se incluye en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto con el título «Ganancia/(pérdida) neta realizada en ventas de inversiones» y «Cambio en la ganancia/(pérdida) neta no realizada en inversiones».

¹Para los valores de renta fija, los costes de transacción no son identificables por separado del precio de compra del valor y, por lo tanto, no se podrán revelar por separado.

²Consulte la nota 1.

Notas a los estados financieros

(continuación)

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS EN EFECTIVO

La siguiente tabla muestra los saldos de garantía en efectivo adeudados a y por los corredores a 30 de septiembre de 2019:

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Debidas por los intermediarios - Garantías pagadas				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Forwards y swaps	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Swaps	USD	780.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Forwards y swaps	USD	2.270.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	Barclays	Forwards y swaps	EUR	440.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Forwards y swaps	EUR	550.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Barclays	Forwards	EUR	400.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	JPM Chase	Forwards y swaps	EUR	40.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Citigroup Global Markets	Forwards	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Goldman Sachs	Swaps	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Barclays	Swaps	EUR	360.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	JPM Securities	Swaps	EUR	1.650.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPM Chase	Forwards	USD	320.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPM Chase	Forwards	USD	480.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Chase	Forwards	USD	1.610.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Citigroup Global Markets	Forwards	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPM Chase	Forwards	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Barclays	Forwards	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Lloyds	Forwards	USD	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPM Chase	Forwards y swaps	USD	180.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Forwards	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Chase	Forwards	USD	2.200.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPM Chase	Forwards	USD	440.000
Threadneedle (Lux) - American	JPM Chase	Forwards	USD	1.320.000
Threadneedle (Lux) - American Select	JPM Chase	Forwards	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	JPM Chase	Forwards	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPM Chase	Forwards	USD	320.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPM Chase	Forwards	USD	350.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPM Chase	Forwards	GBP	40.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Forwards	USD	2.170.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Royal Bank of Scotland	Forwards	EUR	430.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Credit Suisse	Swaps	EUR	1.380.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Forwards y swaps	EUR	3.000.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Forwards y swaps	EUR	7.610.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Swaps	EUR	16.420.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	140.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Barclays	Forwards y swaps	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Forwards y swaps	EUR	750.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Goldman Sachs	Swaps	EUR	2.430.000
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	JPM Chase	Forwards	GBP	30.000
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	UBS	Swaps	GBP	40.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	126.000
Debidas por los intermediarios - Garantías recibidas				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Citigroup Global Markets	Swaps	USD	430.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays	Forwards y swaps	USD	660.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citigroup Global Markets	Forwards y swaps	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Goldman Sachs	Forwards	USD	640.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	JPM Chase	Forwards	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPM Chase	Forwards	EUR	440.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPM Chase	Forwards	EUR	200.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Forwards	GBP	240.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	350.000

Notas a los estados financieros

(continuación)

17 INFORMACIÓN SOBRE GARANTÍAS EN EFECTIVO

(continuación)

Carteras	Contraparte	Tipo de inversión	Divisa	Garantía en efectivo
Debidas por los intermediarios - Garantías recibidas (continuación)				
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Chase	Forwards y swaps	EUR	140.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Forwards y swaps	EUR	2.040.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Chase	Forwards y swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Forwards y swaps	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	JPM Chase	Forwards	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Citigroup Global Markets	Swaps	USD	570.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Credit Suisse	Swaps	USD	870.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	1.740.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Forwards y swaps	USD	2.110.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	2.930.000

*Consulte la nota 1.

18 INVERSIÓN CRUZADA EN CARTERAS

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	EUR	732.985	0,21
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	EUR	143.326	0,10
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	2.894.674	2,15
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	1.719.575	0,35
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	3.531.159	4,02
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	691.735	0,06
Threadneedle (Lux) - European Short Term High Yield Bond*	EUR	472.524	1,25

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	1.236.503	0,32
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	2.037.717	1,56
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	USD	2.072.704	2,16

A 30 de septiembre de 2019, Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income Portfolio invierte en acciones de las siguientes Carteras:

Cartera	Divisa	Valor de mercado	% del patrimonio neto
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	13.498.956	10,33
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income Fund	USD	1.690.462	2,90
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	USD	7.064.181	7,38

El impacto de las transacciones de inversión cruzada ha sido eliminado del Estado en el patrimonio neto y del Estado de Cambios en el Patrimonio Neto.

Consulte también la Nota 2 xi) sobre los reembolsos de comisiones de gestión de activos.

*Consulte la nota 1.

Notas a los estados financieros

(continuación)

19 DEPÓSITOS A PLAZO

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 30 de septiembre de 2019:

Carteras	Contraparte	Divisa	Depósitos a plazo (en la divisa base de la cartera)
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	7.497.300
	Total	EUR	7.497.300
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	Rabobank Nederland Utrecht	EUR	1.499.756
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	1.499.853
	Credit Agricole London	EUR	1.499.810
	Total	EUR	4.499.419
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Lloyds TSB Financial Market	USD	805.418
	Total	USD	805.418
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	BNP Paribas Paris	USD	1.301.142
	Total	USD	1.301.142
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	1.097.181
	BNP Paribas Paris	EUR	499.643
	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	998.598
	Total	EUR	2.595.422
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Mitsubishi UFJ Securities	USD	1.006.258
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	1.508.455
	Lloyds TSB Financial Market	USD	2.203.182
	Total	USD	4.717.895
Threadneedle (Lux) - American Select	Mitsubishi UFJ Securities	USD	3.608.755
	Lloyds TSB Financial Market	USD	5.050.443
	Total	USD	8.659.198
Threadneedle (Lux) - European Select	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	10.499.115
	Total	EUR	10.499.115
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	BNP Paribas Paris	USD	11.210.924
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	11.282.722
	Sumitomo Bank Ltd London	USD	12.108.590
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	12.336.640
	National Bank of Abu Dhabi	USD	12.414.474
	Bank of Nova Scotia	USD	8.698.189
	Lloyds TSB Financial Market	USD	9.648.050
	Total	USD	77.699.589
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	18.000.000
	BNP Paribas Paris	EUR	28.998.549
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	29.975.191
	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	5.652.362
	BNP Paribas Paris	EUR	4.589.965
	Total	EUR	87.216.067
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	BNP Paribas Paris	EUR	2.000.000
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	2.798.756
	Total	EUR	4.798.756
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	ANZ Banking Group Ltd	GBP	450.049
	Mitsubishi UFJ Securities	GBP	302.000
	Lloyds TSB Financial Market	GBP	350.138
	Total	GBP	1.102.187
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Rabobank Nederland Utrecht	USD	911.907
	Total	USD	911.907
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Mitsubishi UFJ Securities	USD	4.518.732
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	4.871.958
	Total	USD	9.390.690

*Consulte la nota 1.

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

El Índice de gastos totales se calcula siguiendo la guía de la Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA).

La fórmula aplicada es la siguiente:

El IGT expresa la suma de todos los costes y comisiones cobrados de forma continua a cada clase de acciones (Gastos operativos) tomadas retrospectivamente como un porcentaje de su patrimonio neto, y se calcula utilizando la siguiente fórmula:

$$\% \text{ de IGT} = \frac{\text{Gastos operativos totales}}{\text{Patrimonio neto promedio}} \times 100$$

Cuando un fondo invierte más del 10% en otros organismos de inversión colectiva (fondos objetivo), el cálculo incluye la parte del fondo en los gastos de los fondos objetivo menos los reembolsos recibidos.

Los Índices de gastos totales para el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2019 son los siguientes:

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,85%	
	AEH	0,85%	
	AKH	0,85%	
	AU	0,85%	
	AUP	0,85%	
	DEC	1,60%	
	DEH	1,60%	
	DU	1,60%	
	DUP	1,70%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEC	0,65%	
	IEH	0,65%	
	IEP	0,65%	
	IGC	0,76%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IGH	0,65%	
	IKH	0,71%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,65%	
	IUP	0,49%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	NEC	0,37%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	NEH	0,45%	
	NGC	0,45%	
	NGH	0,45%	
	NU	0,45%	
	NUP	0,39%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	XGH	0,15%	
	ZEH	0,60%	
	ZGH	0,60%	
	ZU	0,60%	
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	1,20%	
	IE	0,60%	
	ZE	0,70%	
	1E	1,19%	
	1G	1,19%	
	2E	0,58%	
	2G	0,58%	
	3G	0,69%	
	4G	0,08%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT'	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond			
<i>(continuación)</i>			
	8E	0,62%	
	8G	0,62%	
	9G	0,65%	
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond			
	IE	0,85%	
	IEP	1,00%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	XE	0,05%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	ZE	0,90%	
	ZEP	1,01%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	1E	1,38%	
	1EP	1,38%	
	1G	1,38%	
	1GP	1,38%	
	1UT	1,38%	
	2E	0,82%	
	2EP	0,82%	
	2FH	0,82%	
	2G	0,73%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	2GP	0,74%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	3E	0,77%	
	3EP	0,77%	
	3FC	0,77%	
	3FH	0,77%	
	3G	0,77%	
	3GP	0,77%	
	4E	0,07%	
	4G	0,07%	
	4GP	0,07%	
	8E	0,86%	
	8EP	0,86%	
	8FH	0,86%	
	8G	0,86%	
	8GP	0,86%	
	9E	0,73%	
	9EP	0,73%	
	9FC	0,73%	
	9FH	0,73%	
	9G	0,73%	
	9GP	0,73%	
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*			
	AE	0,78%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	AEP	0,78%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT'	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*			
(continuación)			
	AKH	0,84%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	ANH	0,78%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	IE	0,50%	
	IEP	0,42%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	IGC	0,50%	
	IGH	0,43%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	XE	0,10%	
	XGH	0,10%	
	ZE	0,55%	
Threadneedle (Lux) - European Social Bond			
	IE	0,50%	
	IEP	0,50%	
	IFH	0,50%	
	IKH	0,50%	
	LE	0,40%	
	NEP	0,40%	
	ZE	0,55%	
	ZEP	0,55%	
	ZFH	0,55%	
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond			
	AE	1,15%	
	AEP	1,15%	
	AKH	1,15%	
	AUH	1,15%	
	DE	1,70%	
	DEP	1,70%	
	DUH	1,83%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IE	0,55%	
	W	1,15%	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds			
	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,73%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	ANH	1,65%	
	ASH	1,65%	
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEC	1,75%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IEH	0,85%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds			
<i>(continuación)</i>			
	IU	0,96%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	W	1,30%	
	WEH	1,30%	
	XUP	0,06%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt			
	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,72%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	ANH	1,65%	
	ASH	1,65%	
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IEH	0,85%	
	IU	0,85%	
	SU	1,80%	
	SUP	1,80%	
	W	1,30%	
	XUP	0,05%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,90%	
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds			
	AEC	1,60%	
	AEH	1,60%	
	AKH	1,71%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	ANH	1,60%	
	ASC	1,60%	
	ASH	1,60%	
	AU	1,60%	
	AUP	1,60%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IEH	0,85%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZEH	0,90%	
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond			
	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	ASH	1,55%	
	AU	1,55%	
	AUP	1,55%	
	DEC	1,75%	
	DEH	1,75%	
	DU	1,75%	
	IEC	0,65%	
	IEH	0,65%	
	IU	0,65%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond			
<i>(continuación)</i>			
	TEH	0,65%	
	XUP	0,05%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZFH	1,00%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZGH	0,83%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	0,90%	
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond			
	AEH	1,55%	
	AKH	1,70%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	AS	1,55%	
	ASC	1,55%	
	ASH	1,55%	
	AU	1,55%	
	AUP	1,55%	
	AVC	1,62%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	AVH	1,71%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEH	1,75%	
	IEH	0,80%	
	IGH	0,80%	
	ISH	0,80%	
	IU	0,80%	
	XU	0,15%	
	ZU	0,90%	
	ZUP	0,99%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return			
	AE	1,63%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	AEP	1,63%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	DE	2,38%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	IE	0,93%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	IEP	0,93%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	LE	0,78%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	LEP	0,78%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	ZE	1,13%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.
	ZEP	1,13%	El IGT suizo incluye el coste sintético de la tenencia de las inversiones subyacentes, que durante el periodo de referencia equivale a 8 puntos básicos anualizados.

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AEC	1,65%	
	AEH	1,65%	
	AKH	1,74%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	AU	1,65%	
	AUP	1,65%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	0,95%	
	IGH	0,95%	
	IU	0,95%	
	W	1,75%	
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AE	1,55%	
	AEC	1,55%	
	AEH	1,55%	
	AEP	1,55%	
	AS	1,61%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASC	1,55%	
	ASH	1,55%	
	ASP	1,55%	
	AU	1,55%	
	AUM	1,45%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	AUP	1,55%	
	DEC	2,30%	
	DEH	2,30%	
	DEP	2,30%	
	DU	2,30%	
	DUP	2,30%	
	ZE	1,05%	
	ZEC	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,11%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	IE	0,95%	
	IEH	0,95%	
	IU	0,95%	
	IUP	1,02%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	W	1,75%	
	XU	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEP	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZU	1,05%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	IEH	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,71%	
	1U	1,71%	
	2E	1,10%	
	2U	1,04%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	8E	1,14%	
	8U	1,14%	
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	AEC	1,87%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	AUP	1,80%	
	DEC	2,30%	
	DUP	2,36%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	1,02%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	TE	1,09%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1SC	1,68%	
	1SH	1,68%	
	1ST	1,68%	
	1U	1,68%	
	1UP	1,68%	
	1VT	1,68%	
	2E	1,07%	
	2EP	1,07%	
	2U	1,00%	Debido al uso del método de cálculo promedio y a que se ha recibido una gran cantidad de reembolsos de esta clase de acciones, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto.
	2UP	1,07%	
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
	3U	0,93%	
	3UP	0,93%	
	8E	1,11%	
	8EP	1,11%	
	8U	1,11%	
	8UP	1,11%	
	9E	0,78%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9EP	0,74%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9U	0,76%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9UP	0,77%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Select	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Select			
<i>(continuación)</i>			
	1U	1,68%	
	2E	1,07%	
	2U	1,07%	
	3U	0,90%	
	8E	1,11%	
	8U	1,11%	
	9U	0,86%	
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies			
	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AUP	1,89%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,30%	
	IE	0,95%	
	NE	0,75%	
	XE	0,15%	
	XG	0,15%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZFH	1,12%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZU	1,05%	
Threadneedle (Lux) - American			
	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,15%	
	DU	2,15%	
	IEH	0,90%	
	IU	0,90%	
	W	1,50%	
	ZE	1,00%	
	ZEH	1,00%	
	ZU	1,00%	
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2E	1,06%	
	2U	1,06%	
	3EH	0,88%	
	3U	0,88%	
	8E	1,10%	
	8U	1,10%	
	9EH	0,84%	
	9U	0,84%	
Threadneedle (Lux) - American Select			
	AD	1,71%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	AEH	1,80%	
	AN	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - American Select			
<i>(continuación)</i>			
	ID	0,96%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	IE	1,14%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	IEH	1,00%	
	IN	1,15%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	W	1,75%	
	ZEH	1,03%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZU	1,10%	
	1E	1,67%	
	1EH	1,67%	
	1EP	1,67%	
	1U	1,67%	
	2EH	1,00%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	2U	1,06%	
	3E	0,87%	
	3U	0,87%	
	8EH	1,10%	
	8U	1,10%	
	9E	0,83%	
	9U	0,76%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies			
	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IE	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,68%	
	1EP	1,68%	
	1U	1,68%	
	2U	1,07%	
	3EH	0,93%	
	3U	0,93%	
	8U	1,11%	
	9EH	0,76%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9U	0,89%	
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity			
	AE	1,80%	
	AF	1,80%	
	AS	1,86%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ASH	1,80%	
	AU	1,80%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity			
<i>(continuación)</i>			
	DE	2,55%	
	IE	0,95%	
	IF	0,95%	
	ISH	0,95%	
	IU	0,95%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZF	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZU	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Asia Equities			
	IE	0,95%	
	IU	0,95%	
	ZU	1,05%	
	1E	1,70%	
	1U	1,70%	
	2E	1,09%	
	2U	1,09%	
	3U	0,95%	
	8E	1,04%	Debido al uso del método de cálculo promedio y a que se ha recibido una gran cantidad de reembolsos de esta clase de acciones, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto.
	8U	1,13%	
	9U	0,91%	
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income			
	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AF	1,80%	
	AFP	1,80%	
	ASC	1,80%	
	ASH	1,80%	
	ASP	1,90%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	AVC	1,80%	
	AVH	1,80%	
	DE	2,55%	
	IE	0,95%	
	IEP	0,95%	
	IF	0,95%	
	IFP	1,02%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ISH	0,95%	
	IU	1,01%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IUP	1,02%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZEP	1,05%	
	ZF	1,05%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income (continuación)			
	ZFP	1,05%	
	ZU	1,05%	
	ZUP	1,05%	
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities			
	AEC	1,85%	
	AEH	1,85%	
	AU	1,85%	
	AUP	1,85%	
	DU	2,35%	
	IU	1,05%	
	XS	0,15%	
	XSH	0,15%	
	ZEH	1,10%	
	ZFH	1,10%	
	ZGH	1,10%	
	ZU	1,10%	
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities			
	AE	0,70%	
	AEH	0,70%	
	AU	0,70%	
	AUP	0,70%	
	DE	0,90%	
	DEH	0,90%	
	DU	0,90%	
	IE	0,41%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEC	0,35%	
	IEH	0,41%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IFH	0,35%	
	IG	0,35%	
	IU	0,35%	
	ZEH	0,45%	
	ZFH	0,45%	
	ZU	0,45%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities			
	AE	1,80%	
	ASH	1,80%	
	AUH	1,80%	
	DE	2,15%	
	IE	0,95%	
	W	1,75%	
	XE	0,15%	
	ZUH	1,05%	
	1E	1,73%	
	1EP	1,85%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	1G	1,73%	
	1GP	1,81%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	2E	1,08%	
	2G	1,08%	
	2U	0,98%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	3E	0,94%	
	3G	0,94%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities			
<i>(continuación)</i>			
	3GP	0,94%	
	4E	0,08%	
	4G	0,08%	
	8E	1,12%	
	8G	1,12%	
	8U	1,12%	
	9E	0,82%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9G	0,77%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9GP	0,77%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend			
	AE	1,80%	
	AEP	1,80%	
	AUP	1,87%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,15%	
	DEP	2,15%	
	IE	1,03%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IEP	1,03%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	ZE	1,05%	
	ZEP	1,05%	
	1E	1,70%	
	1EP	1,70%	
	1G	1,70%	
	1GP	1,70%	
	2E	1,09%	
	2EP	1,09%	
	2G	1,03%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	2GP	1,03%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	3EP	0,95%	
	3G	0,95%	
	3GP	0,95%	
	4GP	0,09%	
	8E	1,13%	
	8EP	1,13%	
	8G	1,13%	
	8GP	1,13%	
	9EP	0,80%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9G	0,91%	
	9GP	0,91%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities			
	AE	1,85%	
	ASH	1,85%	
	AUH	1,92%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	2,75%	
	DUH	2,83%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities			
<i>(continuación)</i>			
	IE	1,10%	
	W	1,90%	
	ZE	1,10%	
	ZFH	1,24%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies			
	IE	0,95%	
	ZE	1,10%	
	1E	1,72%	
	1EP	1,72%	
	1FH	1,72%	
	1G	1,72%	
	1UH	1,72%	
	2E	1,07%	
	2G	1,07%	
	3E	0,91%	
	3EP	0,91%	
	3FH	0,91%	
	3G	0,91%	
	3GP	0,91%	
	3UH	0,91%	
	4E	0,07%	
	4G	0,07%	
	8E	1,11%	
	8G	1,11%	
	9E	0,87%	
	9EP	0,87%	
	9FH	0,87%	
	9G	0,87%	
	9GP	0,77%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9UH	0,87%	
Threadneedle (Lux) - European Select			
	AE	1,80%	
	AGH	1,80%	
	AUH	1,80%	
	DUH	2,35%	
	IE	0,95%	
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	1E	1,65%	
	1EP	1,65%	
	1SH	1,65%	
	1U	1,65%	
	1UH	1,65%	
	2E	1,06%	
	2EP	1,06%	
	3E	0,88%	
	3U	0,88%	
	8E	1,10%	
	8EP	1,10%	
	9E	0,84%	
	9U	0,84%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	IE	1,07%	Debido al uso del método de cálculo promedio y como clase de acciones lanzada durante el periodo, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. Los cargos de esta clase de acción no exceden el IGT previsto.
	ZE	1,10%	
	1E	1,72%	
	1EP	1,72%	
	1FH	1,72%	
	2E	1,07%	
	3E	0,93%	
	3EP	0,93%	
	3FH	0,93%	
	8E	1,11%	
	9E	0,89%	
	9EP	0,89%	
	9FH	0,95%	
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	AEH	1,80%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	AU	1,80%	
	AUP	1,80%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	DUP	2,55%	
	IEP	0,95%	
	W	2,00%	
	XU	0,15%	
	XUP	0,15%	
	ZG	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZGP	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Global Technology	ZUP	1,05%	
	AEH	1,95%	
	AS	1,95%	
	AU	1,95%	
	AUP	1,95%	
	BU	2,35%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	1,05%	
	IG	1,05%	
	ZEH	1,15%	
	ZFH	1,15%	
	ZG	1,15%	
Threadneedle (Lux) - UK Equities	ZU	1,15%	
	AEH	1,80%	
	AFH	1,88%	
	AG	1,80%	
	AGP	1,80%	
	DEH	2,60%	
	DG	2,60%	
	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	ZEH	1,05%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - UK Equities			
<i>(continuación)</i>			
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGP	1,05%	
	ZUH	1,05%	
	3EH	0,87%	
	3FH	0,78%	Debido al uso del método de cálculo promedio y a que se ha recibido una gran cantidad de reembolsos de esta clase de acciones, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto.
	3UH	0,87%	
	9EH	0,83%	
	9EP	0,83%	
	9FH	0,83%	
	9G	0,83%	
	9UH	0,83%	
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income			
	AE	1,80%	
	AEC	1,80%	
	AEH	1,80%	
	AG	1,80%	
	ASC	1,80%	
	AUC	1,80%	
	DE	2,55%	
	DEC	2,65%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	DEH	2,55%	
	DG	2,55%	
	DGP	2,55%	
	IE	0,85%	
	IEH	0,85%	
	IG	0,85%	
	IGP	0,85%	
	IU	0,85%	
	IUH	0,67%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	LG	0,70%	
	LGP	0,70%	
	ZE	1,05%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZG	1,05%	
	ZGP	1,05%	
	ZUH	1,05%	
	1EH	1,64%	
	1FH	1,64%	
	1UH	1,64%	
	3EH	0,88%	
	3FH	0,88%	
	3UH	0,88%	
	9EH	0,84%	
	9FH	0,90%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	9G*	0,84%	
	9UH	0,84%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	IU	1,60%	
	ZU	1,60%	
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	AEH	1,80%	
	AFH	1,80%	
	AGH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,30%	
	IEH	0,95%	
	IGH	0,95%	
	IU	0,95%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05% / 1,75%	
	ZEH	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZU	1,05% / 0,98%	
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	ZE	0,80%	
	1E	1,17%	
	1EP	1,17%	
	1GH	1,17%	
	1UH	1,17%	
	2E	0,56%	
	2EP	0,43%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	2GC	0,56%	
	2GH	0,56%	
	4GH	0,06%	
	8E	0,60%	
	8EP	0,60%	
	8GC	0,60%	
	8GH	0,60%	
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	AE	1,20%	
	AFH	1,14%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	AKH	1,20%	
	ANH	1,20%	
	AUH	1,13%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	DE	1,75%	
	IE	0,55%	
	IEP	0,55%	
	IGH	0,55%	
	IU	0,47%	Debido al uso del método de cálculo promedio y a que se ha recibido una gran cantidad de reembolsos de esta clase de acciones, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto. La comisiones para esta clase de acciones no exceden el IGT esperado.
	IUH	0,55%	
	JE	0,45%	
	JGH	0,45% / 0,59%	
	JUH	0,52% / 0,83%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	LE	0,40%	
	LEP	0,40%	
	LGH	0,40%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities (continuación)			
	YE	0,60%	
	YGH	0,60% / 0,74%	
	YUH	0,60% / 0,97%	
	ZE	0,70%	
	ZFH	0,70%	
	ZGH	0,70%	
	ZUH	0,70%	
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha			
	AE	1,85% / 3,95%	
	AEP	1,85%	
	AUH	1,85% / 6,56%	Debido al pequeño tamaño de la clase de acciones, la comisión de rendimiento anualizada incluida en el IGT no es representativa.
	DE	2,35% / 5,05%	
	IE	0,95% / 2,31%	
	IGH	0,95%	
	LE	0,58% / 1,93%	
	XGH	0,15%	
	ZE	1,05% / 3,22%	
	ZF	1,05% / 3,59%	Debido al pequeño tamaño de la clase de acciones, la comisión de rendimiento anualizada incluida en el IGT no es representativa.
	ZFH	1,11% / 4,39%	Debido al pequeño tamaño de la clase de acciones, la comisión de rendimiento anualizada incluida en el IGT no es representativa.
	ZGH	1,05% / 4,83%	Debido al pequeño tamaño de la clase de acciones, la comisión de rendimiento anualizada incluida en el IGT no es representativa.
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha			
	AEH	1,92% / 2,54%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	AG	1,80% / 2,67%	
	DEH	2,36% / 2,91%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	DG	2,42% / 3,19%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IG	0,95% / 2,02%	
	ZG	1,05% / 2,06%	
	1E	1,68%	
	1EH	1,68%	
	2E	0,94% / 1,95%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	2EH	1,07% / 2,83%	
	3EH	0,87%	Debido al uso del método de cálculo promedio y a que se ha recibido una gran cantidad de reembolsos de esta clase de acciones, el IGT actual difiere ligeramente del IGT del ejercicio completo previsto.
	3FH	0,93%	
	8E	1,11%	
	8EH	1,11%	
	9EH	0,89% / 8,68%	Debido al pequeño tamaño de la clase de acciones, y dado que la clase se lanzó durante el período, la comisión de rendimiento anualizada incluida en el IGT no es representativa.
	9FH	0,89% / 1,66%	
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha			
	AEH	1,80%	
	AU	1,80%	
	DEH	2,30%	
	DU	2,37%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IU	0,90%	

Notas a los estados financieros

(continuación)

20 ÍNDICE DE GASTOS TOTALES (IGT)

(continuación)

Cartera	Clase	IGT/IGT ¹	Comentarios
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha			
<i>(continuación)</i>			
	ZU	1,05%	
	1E	1,69%	
	1EH	1,69%	
	1U	1,69%	
	2E	0,83%	
	2U	0,83%	
	3U	0,94% / 0,70%	
	8E	0,87% / 0,39%	
	8U	0,87% / -1,18%	El elemento de comisión de rendimiento incluido en la transferencia de activos al fondo al 26 de enero de 2019 ha distorsionado el IGT, incluida la comisión de rendimiento.
	9U	0,79%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha			
	AEH	1,86% / 8,30%	Debido al pequeño tamaño de la clase de acciones, y dado que la clase se lanzó durante el período, el IGT actual difiere del IGT previsto para el ejercicio completo y la comisión de rendimiento anualizada incluida en el IGT no es representativa.
	AU	1,80% / 2,03%	
	DEH	2,30% / 2,95%	
	DU	2,30% / 3,54%	
	IU	0,90%	
	ZU	1,05% / 2,52%	
	1E	1,69%	
	1U	1,69% / 1,75%	
	2E	0,83% / 2,22%	
	2U	0,83% / 2,39%	
	8E	0,87% / 1,28%	
	8U	0,87%	
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities			
	AEH	2,05%	
	AFH	2,05%	
	AGH	2,05%	
	ASH	2,05%	
	AU	2,05%	
	DEH	2,55%	
	DU	2,55%	
	IEH	1,00%	
	IFH	1,00%	
	IG	1,06%	El IGT actual difiere del IGT de todo el año esperado debido al tamaño pequeño de la clase.
	IGH	1,00%	
	IU	1,00%	
	NG	0,65%	
	XU	0,15%	
	ZEH	1,05%	
	ZFH	1,05%	
	ZGH	1,05%	
	ZU	1,05%	
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity			
	AU	1,85%	
	XU	0,25%	

¹ El IGT incluye la comisión de rentabilidad.

* Consulte la nota 1.

Información para los accionistas

La SICAV es una sociedad de inversión organizada como una «Société d'Investissement à Capital Variable» en el Gran Ducado de Luxemburgo en virtud de la Ley del 10 de agosto de 1915, en su versión modificada, y califica como un organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios («OICVM») en virtud de la Parte I de la Ley del 17 de diciembre de 2010, en su versión modificada.

La SICAV se constituyó el 10 de febrero de 1995 por un periodo ilimitado. El acta constitutiva de la SICAV se publicó por primera vez en el Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations del Gran Ducado de Luxemburgo (el «Mémorial») el 31 de marzo de 1995. Las modificaciones de 25 de julio de 1997, 12 de marzo de 1999, 18 de agosto de 2004, 17 de octubre de 2005, 25 de julio de 2008, 31 de julio de 2009, 31 de agosto de 2010, 29 de julio de 2011, 13 de agosto de 2012, 28 de marzo de 2013 y 12 de agosto de 2013 se publicaron en el Mémorial el 30 de octubre de 1997, 22 de abril de 1999, 15 de septiembre de 2004, 3 de noviembre de 2005, 10 de septiembre de 2008, 21 de octubre de 2010, 22 de agosto de 2011, 18 de septiembre de 2012, 22 de abril de 2013, 16 de septiembre de 2013 y 12 de octubre de 2018 respectivamente.

La SICAV está registrada en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B-50216.

La junta general anual de Accionistas de la SICAV se celebrará en Luxemburgo, según se especifique en la convocatoria, dentro de los seis meses siguientes al cierre del ejercicio contable. La junta general anual podrá celebrarse en el extranjero si, a juicio absoluto y definitivo del Consejo, las circunstancias excepcionales así lo requieren. Las demás juntas de Accionistas podrán celebrarse en el lugar y plazo de la convocatoria que se especifique en las respectivas convocatorias. Las convocatorias de las juntas generales se realizan de acuerdo con la legislación luxemburguesa y de acuerdo con las normas aplicables en los países pertinentes en los que las Acciones se ofrecen públicamente a la venta. En las convocatorias se especificarán el lugar y la hora de la reunión, las condiciones de admisión, el orden del día, el quórum y los requisitos de votación.

El ejercicio contable de la SICAV finaliza el 31 de marzo de cada año.

El informe anual y los estados financieros auditados y el informe semestral no auditado están disponibles en el domicilio social de la SICAV y en la oficina principal de cada agente pagador y distribuidor. Las cuentas combinadas de la SICAV se expresan en dólares estadounidenses.

El Valor liquidativo y los precios de oferta y reembolso de las acciones de la SICAV se hacen públicos en el domicilio social de la SICAV.

Este informe no constituye una oferta o una solicitud de una oferta para comprar acciones en la SICAV. Las suscripciones se aceptan según el Folleto y el último informe anual disponible que contiene los estados financieros auditados a 31 de marzo y el último informe semestral disponible a 30 de septiembre, si se publican posteriormente.

Ciertas Carteras y/o clases de acciones contenidas en este informe no pueden ser autorizadas u ofrecidas para la venta en todas las jurisdicciones en este momento.

Documento de Información Clave para el Inversor («KIID»): requisitos de suscripción

El KIID es un documento precontractual y los inversores deberán confirmar que han leído el último KIID antes de hacer una suscripción. La Sociedad Gestora tiene el derecho de rechazar una suscripción si el inversor no confirma que ha leído el último KIID en el momento de la solicitud. El último KIID se podrá obtener en www.columbiathreadneedle.com.

Información para inversores en Suiza

El informe anual y los estados financieros auditados, el informe semestral no auditado, el informe sobre los cambios en las tenencias de la Cartera para el año, el acta constitutiva, el Folleto (versión suiza) y el KIID podrán obtenerse previa solicitud y sin coste alguno en las oficinas del Representante suizo y agente de pagos de la SICAV, RBC Investor Services Bank SA, Esch-sur-Alzette, Sucursal de Zürich, Bleicherweg 7, 8027 Zürich, Suiza, o en el domicilio social de la SICAV.

El rendimiento pasado no es un indicio de rendimiento actual o futuro, y los datos de rendimiento no tienen en cuenta las comisiones y los costes incurridos en la emisión y el reembolso de acciones.

Regulación de la transacción de financiación de valores

El Reglamento de operaciones de financiación de valores («SFTR») introduce los requisitos de información para las operaciones de financiación de valores («SFT») y los swaps de rendimiento total. Una SFT se define según el Artículo 3 (11) del SFTR como:

- un acuerdo de recompra/recompra inversa;
- préstamos de valores o materias primas y empréstitos de valores o materias primas;
- una transacción de compra-reventa o una transacción de venta-recompra; o
- una transacción de préstamo de margen.

A 30 de septiembre de 2019, la SICAV realizó swaps de rendimiento total («SRT») como tipo de instrumentos en el alcance del SFTR.

Datos globales

		Ganancias y pérdidas no realizadas en la divisa base		% del patrimonio neto
Nombre de la Cartera	Tipo de activo	de la cartera y en valor absoluto		
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	SRT	161.712		0,09
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	657.944		0,65
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	SRT	33.518		0,34
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	170.716		0,16
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	1.706.459		0,95
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	5.114.731		1,32

Datos de reutilización de garantías

No hubo reutilización de garantías durante el periodo finalizado el 30 de septiembre de 2019.

Datos de concentración

Todas las garantías recibidas con respecto a SRT a 30 de septiembre de 2019 son garantías en efectivo. La divulgación de los diez emisores más grandes, por lo tanto, no es aplicable.

La siguiente tabla proporciona detalles de las diez principales contrapartes (basadas en el volumen bruto de transacciones pendientes) con respecto a SRT mantenidas por cada Cartera a 30 de septiembre de 2019.

Nombre de la Cartera	Tipo de activo	Contraparte	Ganancias y pérdidas no realizadas en la divisa base de la cartera y en valor absoluto
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	SRT	Bank of America Merrill Lynch	161.712
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	SRT	Goldman Sachs	657.944
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	SRT	UBS	33.518
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	SRT	Bank of America Merrill Lynch	170.716
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	SRT	UBS	1.706.459
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	SRT	JPMorgan	2.007.662
		Macquarie	1.513.161
		Goldman Sachs	970.598
		Citigroup Global Markets	330.345
		Credit Suisse	292.965

Custodia de garantías recibidas

La garantía en efectivo se recibe en la cuenta de efectivo de cada Cartera en Citibank Europe plc, sucursal de Luxemburgo.

La siguiente tabla muestra los depósitos a plazo que mantiene la SICAV a 30 de septiembre de 2019:

Regulación de la transacción de financiación de valores

(continuación)

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	Bank of America Merrill Lynch	USD	350.000
		Total	USD	350.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	Citigroup Global Markets	USD	570.000
	Efectivo	Credit Suisse	USD	870.000
	Efectivo	Goldman Sachs	USD	1.740.000
	Efectivo	JPMorgan	USD	2.110.000*
	Efectivo	Macquarie	USD	2.930.000
		Total	USD	8.220.000

Datos agregados de la transacción

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Plazo de vencimiento (garantía)	Divisa de garantía	Plazo de vencimiento (SFT/SRT)	País de establecimiento (contraparte)	Liquidación y compensación	Calidad de la garantía
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	más de 1 año	UK	Bilateral	N/A - Efectivo
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	EUR	más de 1 año	UK	Bilateral	N/A - Efectivo
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	GBP	más de 1 año	UK	Bilateral	N/A - Efectivo
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	de 3 meses a 1 año	UK	Bilateral	N/A - Efectivo
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	más de 1 año	UK	Bilateral	N/A - Efectivo
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Efectivo	Vencimiento abierto	USD	menos de 1 día	UK	Bilateral	N/A - Efectivo

La cantidad de garantía concedida por SRT a 30 de septiembre de 2019 es la siguiente:

Nombre de la Cartera	Tipo de garantía	Contraparte	Divisa de garantía	Importe de garantía	% de garantía mantenida al cierre del periodo por categoría
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Efectivo	Goldman Sachs	EUR	2.430.000	2,35
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	Efectivo	UBS	GBP	40.000	0,41
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Efectivo	Bank of America Merrill Lynch	USD	100.000	0,09
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Efectivo	UBS	USD	126.000	0,07

Rendimiento/Costes

El rendimiento y los costes de las transacciones de SRT a 30 de septiembre de 2019 se revelan en el Estado de operaciones y variaciones en el patrimonio neto de la Cartera correspondiente bajo los títulos «Gastos por intereses en swaps», «Ganancia/(pérdida) neta realizada en swaps» y «Cambio en la ganancia/(pérdida) neta no realizada en swaps».

* Este importe de garantía podrá estar relacionado con transacciones que no sean SRT que no están cubiertas por la divulgación de SFT.

Directorio

Domicilio social

31 Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Gran Ducado de Luxemburgo

Asesor de inversiones

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

Sociedad Gestora

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Delegado a¹:

Columbia Management
Investment Advisers, LLC
225 Franklin Street
Boston MA 02110
Estados Unidos de América

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities²
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
Threadneedle (Lux) - Global Technology

Threadneedle Asset
Management Limited
Cannon Place
78 Cannon Street
London EC4N 6AG
United Kingdom

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond³
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond⁴
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond³
Threadneedle (Lux) - European Social Bond
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds⁴
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt⁴
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds⁴
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond⁵
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income⁶
Threadneedle (Lux) - Global Focus
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
Threadneedle (Lux) - Global Select
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - American⁶
Threadneedle (Lux) - American Select⁶
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies⁶
Threadneedle (Lux) - Asia Equities⁷
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - European Select
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income⁷
Threadneedle (Lux) - UK Equities
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha⁶
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity⁸

Threadneedle Investments
Singapore (Pte.) Limited
3 Killiney Road
#07-07 Winsland House 1
Singapore 239519
Singapur

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity⁹
Threadneedle (Lux) - Asian Focus³
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income⁹

STANLIB Asset Management (Pty.) Limited Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity
17 Melrose Boulevard
Melrose Arch 2196
Johannesburgo
Sudáfrica

¹Sujeto a la responsabilidad y supervisión de Threadneedle Management Luxembourg S.A.

²Columbia Management Investment Advisers, LLC fue nombrado subconsejero el 1 de julio de 2019 (anteriormente Threadneedle Asset Management Limited). Desde el 1 de julio, Threadneedle Asset Management Limited le hace recomendaciones de inversión a Columbia Management Investment Advisers, LLC (previamente, Columbia Management Investment Advisers, LLC le hacía las recomendaciones de inversión a Threadneedle Asset Management Limited).

³Consulte la nota 1, página 207.

⁴Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discrecionales de parte de los activos de la Cartera a Columbia Management Investment Advisers, LLC.

⁵Threadneedle Asset Management Limited fue nombrado subconsejero el 1 de julio de 2019 (anteriormente Threadneedle Investments Singapore (Pte)). A partir del 1 de julio, Threadneedle Asset Management Limited delegó la administración de inversiones discrecionales de parte de los activos a Threadneedle Investments Singapore (Pte).

⁶Columbia Management Investment Advisers, LLC hace recomendaciones de inversión a Threadneedle Asset Management Limited y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Threadneedle Asset Management Limited.

⁷A partir del 1 de julio de 2019, Threadneedle Asset Management Limited podrá, sujeto a su propia responsabilidad, delegar la gestión de inversiones discrecionales de parte de los activos de la Cartera a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

⁸La Sociedad Gestora ha designado un Consejo de Supervisión de Shariah para supervisar el cumplimiento de Directrices de Sharia y Gatehouse Bank plc, con su dirección en 14 Grosvenor Street, Londres, W1K 4PS, Reino Unido, como Asesor de Shariah.

⁹Columbia Management Investment Advisers, LLC hace recomendaciones de inversión a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited y, por lo tanto, proporciona asesoramiento de inversión respaldado por investigación a Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited.

Directorio

(continuación)

Depositorio, domiciliario, administrativo y de pagos

Citibank Europe plc, filial de Luxemburgo
31, Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Gran Ducado de Luxemburgo

Agente de registro y transmisiones

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.
47, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Distribuidor (delegado a una variedad de distribuidores)

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Representantes y agentes de pago

En Austria

Erste Bank der oesterreichischen Sparkassen AG
Graben 21
A-1010 Viena
Austria

En Bélgica

CACEIS Belgium S.A.
Avenue du Port 86 C b 320
B-1000 Bruselas
Bélgica

En Francia

CACEIS Bank France
1/3 Place Valhubert
F-75206 Paris Cedex 13
Francia

En Alemania

J.P. Morgan AG
Junghofstrasse 14
D-60311 Fráncfort del Meno
Alemania

En Hong Kong

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre
1 Sham Mong Road
Kowloon
Hong Kong

En Suiza

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette
Filial de Zürich
Bleicherweg 7
CH-8027 Zürich
Suiza

Auditor

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443
L-1014 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Asesores Legales en Luxemburgo

Linklaters LLP
35 Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107
L-1011 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Para obtener más información, visite columbiathreadneedle.com



publicado por Threadneedle Management Luxembourg S.A. registrada en el Registro Mercantil (Luxemburgo), con el número B 110242, 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo. En Reino Unido, emitido por Threadneedle Asset Management Limited (TAML), registrada en Inglaterra y Gales, con el número de registro 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, Londres EC4N 6AG, Reino Unido. Autorizada y regulada en el Reino Unido por la Autoridad de Conducta Financiera. Columbia Threadneedle Investments es la marca global del grupo de empresas Columbia y Threadneedle. columbiathreadneedle.com

296860